

Central Daily Market Report

2024年9月9日（月）
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2024年9月9日 需給速報	2024年9月10日 需給予想	2024年9月11日 当社予想			
銀行券	500	500	500			
財政	6,900	6,100	▲ 24,000			
資金過不足	7,400	6,600	▲ 23,500			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,200					
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 16,600	14,700		16,600		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	11,300		23,100		▲ 23,500	
当座預金残高	5,437,600		5,460,700		5,437,200	
準備預金残高	4,865,900		9月10日以降の残り所要積立額 積数 200 1日平均 0			
積み終了先	4,865,900					
超過準備	4,865,900					
非準備預金先	571,700					
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額					4,071,500	
準備預金進捗率	実績 100.00%		日数		80.65%	

●2024年9月9日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担保コールO/N物は、出会いの水準に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズから、0.226%～0.228%程度で推移した。ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.23～0.250%程度での出会いとなった。
SCIは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

＜短国市場＞

9日はTB6M物（第1255回）の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。この他、1Y物でも出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は数件の発行が実施された。発行レートは0.25%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

2024/9/9	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.217	0.228	0.227				－	0.248
T/N							－	0.236
S/N							－	－
1W	0.227	0.390	0.230				－	0.200
2W			0.270				－	0.200
3W							－	0.197
1M			0.310				－	0.195
3M							0.078	0.204
6M							0.050	0.253
1Y							0.250	0.318

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.889	+0.044	36,215.75	▲ 175.72	142.48-50	143.15-17
日付					
9/2		9/3	9/4	9/5	9/6
日銀当預残		5,481,900	5,450,600	5,423,300	5,434,500
準備預金残		4,902,900	4,878,000	4,864,400	4,868,300
マネタリーベース		6,725,600	6,693,600	6,666,200	6,677,100
無担O/N加重平均		0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高		115,775	117,244	113,295	116,807
うち無担		77,956	77,759	75,165	76,560
うちO/N		35,809	35,612	32,618	33,613
うち有担		37,819	39,485	38,130	40,247

●入札結果

名称	回号	表面 利率	発行 予定額	発行日	償還日	応募額 （億円）	募入額 （億円）	募入 最低額	募入最高利回・利 回較差	案分率	募入 平均価格	募入平均利回・利 回較差	第I非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	1255	－	35,000	2024/9/10	2025/3/10	92,013	26,905.9	99.955	0.0907%	97.4185%	99.957	0.0867%	8,094

●オペ結果

種類	オファー額 （億円・ 百万ドル）	スタート日	エンド日	貸付 利率	応札総額 （億円・ 百万ドル）	落札総額 （億円・ 百万ドル）	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分 比率
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/9/9	2024/9/10	▲0.050	16,949	16,949		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/9	2024/9/10	▲0.050	0	0				

●2024年9月10日の予定

*8月のマネーストック	*5年利付国債入札（23,000億円、9/11発行）
*7月の特定サービス産業動態統計速報	*エネルギー対策借入（6,402億円、9/20借入）

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。
◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くことがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長（登金）第526号 日本証券業協会加入