

Central Daily Market Report

2024年9月10日(火)

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10日 需給速報	2024年9月11日 需給予想	2024年9月12日 当社予想
銀行券	500	100	▲ 500
財政	3,400	▲ 27,900	2,000
資金過不足	3,900	▲ 27,800	1,500

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						
CP等買入				▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 15,200	16,600		15,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	5,200		▲ 12,800			1,500

当座預金残高	5,442,800	5,430,000	5,431,500	
準備預金残高	4,868,800			
積み終了先	4,868,700			
超過準備	4,868,700			
非準備預金先	574,000			
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	83.87%

●2024年9月10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散見された。

<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>

10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は大型発行を含め、複数の業態で発行が実施された。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

2024/9/10	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	売買参考値 平均値
O/N	0.218	0.275	0.228				-	0.234
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W	0.235	0.275	0.272				-	0.202
2W							-	0.201
3W							-	0.198
1M							-	0.197
3M							0.078	0.204
6M							0.065	0.253
1Y							0.250	0.317

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)
0.890	+0.001	36,159.16	▲ 56.59	143.18-20	143.60-62

日付	9/3	9/4	9/5	9/6	9/9
日銀当預残	5,450,600	5,423,300	5,434,500	5,426,300	5,437,600
準備預金残	4,878,000	4,864,400	4,868,300	4,862,600	4,866,400
マネタリーベース	6,693,600	6,666,200	6,677,100	6,668,600	6,679,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	117,244	113,295	116,807	116,768	115,222
うち無担	77,759	75,165	76,560	75,464	75,562
うちO/N	35,612	32,618	33,613	33,417	32,375
うち有担	39,485	38,130	40,247	41,304	39,660

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	172	0.5%	23,000	2024/9/11	2029/6/20	65,591	17,450	99.88	0.525%	23.0916%	99.90	0.521%	5,531	10
エネルギー対策	-	-	6,402	2024/9/20	2025/9/22	40,422	6,402		0.389%	68.0000%		0.363%		

●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	応募総額(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
米ドル資金供給		2024/9/12	2024/9/19	5.590	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/10	2024/9/11	▲ 0.050	15,527	15,527		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/10	2024/9/11	▲ 0.050	0	0				

●2024年9月11日の予定

*秋田県金融経済懇談会において中川日銀審議委員講演	*8月の米消費者物価指数
---------------------------	--------------

◆本資料は信頼できるとさ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場合があります。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