

Central Daily Market Report

2024年9月11日(水)

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11日 需給速報	2024年9月12日 需給予想	2024年9月13日 当社予想
銀行券	0	▲ 300	▲ 500
財政	▲ 30,600	4,400	▲ 9,000
資金過不足	▲ 30,600	4,100	▲ 9,500

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			12,200			
CP等買入		▲ 200				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					121,500	▲ 132,300
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	▲ 15,100	15,200		15,100		
当預増減	▲ 30,700		31,300		▲ 20,300	

当座預金残高	5,412,100	5,443,400	5,423,100	
準備預金残高	4,839,700			
積み終了先	4,839,700			
超過準備	4,839,700			
非準備預金先	572,400			
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	87.10%

●2024年9月11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、出合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。

<レボ市場>

GC T/Nは、0.235~0.250%程度での出合いとなった。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>

11日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額出合いが見られた。

<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

2024/9/11	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.215	0.229	0.227				-	0.251
T/N							-	0.235
S/N							-	-
1W			0.228				-	0.203
2W	0.300	0.320	0.314				-	0.201
3W							-	0.197
1M	0.320	0.350	0.337				-	0.198
3M			0.370				0.078	0.205
6M							0.065	0.251
1Y							0.235	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)
0.850	▲ 0.040	35,619.77	▲ 539.39	142.23-26	141.37-39
日付	9/4	9/5	9/6	9/9	9/10
日銀当預残	5,423,300	5,434,500	5,426,300	5,437,600	5,442,800
準備預金残	4,864,400	4,868,300	4,862,600	4,866,400	4,868,800
マネタリーベース	6,666,200	6,677,100	6,668,600	6,679,300	6,684,000
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	113,295	116,807	116,768	115,222	121,025
うち無担	75,165	76,560	75,464	75,562	80,226
うちO/N	32,618	33,613	33,417	32,375	33,909
うち有担	38,130	40,247	41,304	39,660	40,799

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	全取レート・利回較差	平均落札レート・利回較差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2024/9/12			9,522	3,505	▲0.019		▲0.015	6.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,750	2024/9/12			6,284	3,752	▲0.030		▲0.025	2.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2024/9/12			9,215	4,008	▲0.033		▲0.032	87.7
国債買入(残存期間25年起)	750	2024/9/12			2,183	753	▲0.012		▲0.010	75.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/11	2024/9/12	▲0.050	15,305	15,305		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/11	2024/9/12	▲0.050	100	100		▲0.050	▲0.050	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率(変動)	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間1年(新規貸付)	2024/9/13	2025/9/12	0.25	121,454

●2024年9月12日の予定

*岡山県金融経済懇談会において田村日銀審議委員講演	*ECB定例理事会	*20年利付国債入札(10,000億円、9/13発行)
*8月の企業物価指数	*8月の米生産者物価指数	
*7-9月期の法人企業景気予測調査季報	*8月の米財政収支	

◆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