

Central Daily Market Report

2024年9月12日(木)

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12日 需給速報	2024年9月13日 需給予想	2024年9月17日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 100	1,500
財政	1,700	▲ 2,500	6,000
資金過不足	1,400	▲ 2,600	7,500

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				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			121,500	▲ 128,300		
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 15,700	15,100		15,700		

当預増減	12,900	6,100	7,500
------	--------	-------	-------

当座預金残高	5,425,000	5,431,100	5,438,600
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,853,900		
積み終了先	4,853,900	9月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,853,900	積数	0
非準備預金先	571,100	1日平均	0

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	90.32%
---------	----	---------	----	--------

●短期金融市場関連指標

2024/9/12	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	売買参考値	平均値
O/N	0.215	0.275	0.229				-	0.237
T/N							-	0.207
S/N							-	-
1W							-	0.198
2W							-	0.199
3W							-	0.197
1M			0.325				-	0.198
3M							0.078	0.203
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)
0.860	+0.010	36,833.27	+1,213.50	142.65-67	142.74-76

日付	9/5	9/6	9/9	9/10	9/11
日銀当預残	5,434,500	5,426,300	5,437,600	5,442,800	5,412,100
準備預金残	4,868,300	4,862,600	4,866,400	4,868,800	4,839,700
マネタリーベース	6,677,100	6,668,600	6,679,300	6,684,000	6,653,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%
コール市場残高	116,807	116,768	115,222	121,025	120,683
うち無担	76,560	75,464	75,562	80,226	79,717
うちO/N	33,613	33,417	32,375	33,909	33,600
うち有担	40,247	41,304	39,660	40,799	40,966

●入札結果

名称	回数	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)
20年利付国債	189	1.9%	10,000	2024/9/13	2044/6/20	26,625	7,662	102.90	1.703%	26.9379%	103.10	1.690%	2,334

●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)		2024/9/12	2024/9/13	▲0.050	15,827	15,827		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/12	2024/9/13	▲0.050	93	93		▲0.050	▲0.050	

●2024年9月13日の予定

*9月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1256回)入札(3ヶ月、46,000億円、9/17発行)
---------------------	---------------------------------------

◆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

●2024年9月12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。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.18~0.24%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>

12日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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。