

●資金需給

単位：億円	2024年9月13日 需給速報		2024年9月17日 需給予想		2024年9月18日 当社予想	
銀行券	▲ 100		200		1,000	
財政	▲ 700		7,400		1,000	
資金過不足	▲ 800		7,600		2,000	
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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 14,500	15,700		14,500		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 6,600		22,000		▲ 6,000	
当座預金残高	5,418,400		5,440,400		5,434,400	
準備預金残高	4,857,600					
積み終了先	4,857,600		9月17日以降の残り所要積立額 積数 462,800 1日平均 16,000			
超過準備	4,857,600					
非準備預金先	560,800					
積み期間(9/16～10/15)の所要準備額					3,940,700	
準備預金進捗率	実績 88.26%		日数		3.33%	

●短期金融市場関連指標

2024/9/13	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	0.215	0.275	0.227				-	0.244
T/N							-	0.243
S/N							-	-
1W			0.227				-	0.201
2W							-	0.198
3W							-	0.197
1M	0.340	0.430	0.388				-	0.198
3M							0.065	0.203
6M							0.095	0.251
1Y							0.230	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)
0.840	▲ 0.020	36,581.76	▲ 251.51	141.50-53	140.89-92

日付	9/6	9/9	9/10	9/11	9/12
日銀当預残	5,426,300	5,437,600	5,442,800	5,412,100	5,425,000
準備預金残	4,862,600	4,866,400	4,868,800	4,839,700	4,853,900
マネタリーベース	6,668,600	6,679,300	6,684,000	6,653,300	6,666,500
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%	0.229%
コール市場残高	116,768	115,222	121,025	120,683	118,621
うち無担	75,464	75,562	80,226	79,717	79,240
うちO/N	33,417	32,375	33,909	33,600	32,493
うち有担	41,304	39,660	40,799	40,966	39,381

●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	1256	-	46,000	2024/9/17	2024/12/16	108,547	34,689.6	99.9835	0.0669%	77.6548%	99.9860	0.0567%	11,310

●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)		2024/9/13	2024/9/17	▲0.050	14,762	14,762		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/13	2024/9/17	▲0.050	0	0				

●2024年9月16日の予定

*敬老の日

●2024年9月17日の予定

*7月の第3次産業活動指数	*米FOMC(1日目) *8月の米小売売上高	*8月の米鉱工業生産・設備稼働率 *7月の米企業在庫
---------------	---------------------------	-------------------------------

◆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13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、来積みを含む4日積みではあったものの、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、目立った出合いがなく閑散であった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.24~0.255%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＞

13日はTB3M物(第1256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、閑散で特段の出合いは見られなかった。この他、6M物と1Y物でも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。