

Central Daily Market Report

2024年9月17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17日 需給速報		2024年9月18日 需給予想		2024年9月19日 当社予想					
銀行券	200		400		▲ 500					
財政	8,700		6,600		▲ 1,000					
資金過不足	8,900		7,000		▲ 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			8,000	▲ 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）										
被災地支援										
社債等買入										
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 19,800	14,500		19,800						
※ドル資金供給用担保国債供給										
当預増減	3,500		26,700		▲ 1,500					
当座預金残高	5,421,900		5,448,600		5,447,100					
準備預金残高	4,876,500		9月18日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>82,600</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>3,000</td></tr></table>				積数	82,600	1日平均	3,000
積数	82,600									
1日平均	3,000									
積み終了先	4,796,500									
超過準備	4,496,300									
非準備預金先	545,400									
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 97.90%		日数		6.67%					

●2024年9月17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、地域金融強化のための特別当座預金制度の適用が一部終了したことで、地銀勢の資金調達ニーズに減退する動きが見られたため、出合いレートは若干低下し、0.226～0.227%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、0.24～0.255%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＞

17日のアウトラ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発行市場は複数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

2024/9/17	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	0.215	0.275	0.228				－	0.248
T/N							－	0.245
S/N							－	－
1W			0.390				－	0.206
2W							－	0.197
3W							－	0.197
1M			0.320				－	0.198
3M			0.340				0.065	0.203
6M							0.095	0.252
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）
0.825	▲ 0.015	36,203.22	▲ 378.54	140.78-80	140.59-61
日付					
9/9		9/10	9/11	9/12	9/13
日銀当預残		5,437,600	5,442,800	5,412,100	5,425,000
準備預金残		4,866,400	4,868,800	4,839,700	4,853,900
マネタリーベース		6,679,300	6,684,000	6,653,300	6,666,500
無担O/N加重平均		0.227%	0.228%	0.227%	0.229%
コール市場残高		115,222	121,025	120,683	118,621
うち無担		75,562	80,226	79,717	79,240
うちO/N		32,375	33,909	33,600	32,493
うち有担		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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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 ・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		2024/9/19	2024/9/26	5.230	2	2				
社債等買入	500	2024/9/20			1,245	500	0.597		0.618	39.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/9/17	2024/9/18	▲0.050	20,262	20,262		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2024/9/18	2024/10/2	0.250	13,152	8,006				60.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/17	2024/9/18	▲0.050	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2024/9/18	2024/9/27	0.220	4	4		0.220	0.220	

●2024年9月18日の予定

*7月の機械受注統計 （市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+0.5%） *8月の貿易統計 *月例経済報告	*米FOMC（2日目）*FRB 米経済見通し発表 *8月の米住宅着工件数 *8月のユーロ圏消費者物価指数改定値 *8月の英消費者物価指数	*国庫短期証券（1257回）入札 （1年、32,000億円、9/20発行）
--	---	--

◆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よう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論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