

# Central Daily Market Report

2024年9月18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18日 需給速報	2024年9月19日 需給予想	2024年9月20日 当社予想			
銀行券	300	0	▲ 500			
財政	▲ 3,100	8,900	49,000			
資金過不足	▲ 2,800	8,900	48,500			
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			12,900			
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			▲ 300	500		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 17,500	19,800	17,500			
当預増減	▲ 600		38,900			49,000
当座預金残高	5,421,300		5,460,200			5,509,200
準備預金残高	4,883,000					
積み終了先	4,868,200					
超過準備	4,846,500					
非準備預金先	538,300					
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	98.83%	日数	10.00%		

## ●2024年9月18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、引き続き邦銀勢の資金調達ニーズが堅調に見られている事から、レート水準は0.226~0.227%程度と前日比で横ばい推移となった。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、0.21~0.245%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>

18日はTB1Y物(第1257回)の入札が実施され、募入平均利回りが強く、ややテールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

### <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

2024/9/18	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	0.218	0.275	0.228				-	0.243
T/N							-	0.239
S/N							-	-
1W							-	0.205
2W			0.320				-	0.197
3W							-	0.198
1M							-	0.198
3M							0.065	0.202
6M							0.100	0.252
1Y							0.260	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)
0.820	▲ 0.005	36,380.17	+176.95	142.00-02	141.87-89
日付	9/10	9/11	9/12	9/13	9/17
日銀当預残	5,442,800	5,412,100	5,425,000	5,418,400	5,421,900
準備預金残	4,868,800	4,839,700	4,853,900	4,857,600	4,876,500
マネタリーベース	6,684,000	6,653,300	6,666,500	6,660,000	6,663,300
無担O/N加重平均	0.228%	0.227%	0.229%	0.227%	0.228%
コール市場残高	121,025	120,683	118,621	120,728	115,425
うち無担	80,226	79,717	79,240	80,391	74,925
うちO/N	33,909	33,600	32,493	33,674	32,815
うち有担	40,799	40,966	39,381	40,337	40,500

## ●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	1257	-	32,000	2024/9/20	2025/9/22	86,605	24,321.8	99.723	0.2762%	86.8878%	99.737	0.2622%	7,678

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2024/9/19			11,546	3,503	▲0.008		▲0.007	98.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,750	2024/9/19			9,079	3,755	▲0.010		▲0.009	16.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2024/9/19			6,277	4,003	▲0.009		▲0.004	17.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/9/19			2,442	1,500	▲0.003		0.003	66.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/18	2024/9/19	▲0.050	17,637	17,637		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/18	2024/9/19	▲0.050	131	131		▲0.050	▲0.050	

## ●2024年9月19日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、20日まで)	*英中銀MPC	*国庫短期証券(1258回)入札(3ヶ月、46,000億円、9/24発行)
*4-6月期の資金循環統計速報	*8月の米中古住宅販売件数	*流動性供給入札(6,500億円、9/20発行)
*7月の石油等消費動態統計		

◆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