

Central Daily Market Report

2024年9月19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19日 需給速報	2024年9月20日 需給予想	2024年9月24日 当社予想
銀行券	100	0	1,500
財政	7,000	51,200	9,000
資金過不足	7,100	51,200	10,500

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	12,900					
CP等買入		▲100		▲600		
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	▲600		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲17,400	17,500		17,400		
当預増減	19,700		67,900		10,500	

当座預金残高	5,441,000	5,508,900	5,519,400	
準備預金残高	4,899,900			
積み終了先	4,887,200			
超過準備	4,886,700			
非準備預金先	541,100			
9月20日以降の残り所要積立額				
積数		32,900		
1日平均		1,300		
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	99.17%	日数	13.33%

●短期金融市場関連指標

2024/9/19	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	0.220	0.275	0.227				-	0.227
T/N							-	0.234
S/N							-	-
1W	0.270	0.275	0.271				-	0.202
2W							-	0.197
3W							-	0.197
1M							-	0.198
3M							0.050	0.202
6M							0.100	0.249
1Y							0.245	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)
0.850	+0.030	37,155.33	+775.16	142.72-74	142.50-52
日付	9/11	9/12	9/13	9/17	9/18
日銀当預残	5,412,100	5,425,000	5,418,400	5,421,900	5,421,300
準備預金残	4,839,700	4,853,900	4,857,600	4,876,500	4,883,000
マネタリーベース	6,653,300	6,666,500	6,660,000	6,663,300	6,662,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.229%	0.227%	0.228%	0.228%
コール市場残高	120,683	118,621	120,728	115,425	114,970
うち無担	79,717	79,240	80,391	74,925	74,914
うちO/N	33,600	32,493	33,674	32,815	32,684
うち有担	40,966	39,381	40,337	40,500	40,056

●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)
国庫短期証券	1258	-	46,000	2024/9/24	2024/12/23	122,356	34,941.8	99.9860	0.0567%	88.5533%	99.9877	0.0498%	11,058
流動性供給	413	-	6,500	2024/9/20	-	19,153	6,494		0.017%	10.5555%		0.013%	

●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)		2024/9/19	2024/9/20	▲0.050	17,657	17,657		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/19	2024/9/20	▲0.050	1	1		▲0.050	▲0.050	

●2024年9月20日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
*日銀総裁定例会見

*8月の全国消費者物価指数(CPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.8%)

◆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