

# Central Daily Market Report

2024年9月20日(金)

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20日 需給速報	2024年9月24日 需給予想	2024年9月25日 当社予想
銀行券	▲ 100	0	1,000
財政	41,700	7,900	▲ 5,000
資金過不足	41,600	7,900	▲ 4,000

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 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	500	▲ 600				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 19,400	17,400	19,400			
※ 下丸資金供給用国債補完供給						
当預増減	38,900		27,300		▲ 4,000	

当座預金残高	5,479,900	5,507,200	5,503,200	
準備預金残高	4,944,500			
積み終了先	4,942,800			
超過準備	4,939,900			
非準備預金先	535,400			
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	99.63%	日数	26.67%

## ●短期金融市場関連指標

2024/9/20	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	0.215	0.227	0.226				-	0.244
T/N							-	0.235
S/N							-	-
1W	0.290	0.295	0.293				-	0.201
2W							-	0.197
3W							-	0.198
1M							-	0.198
3M			0.340				0.050	0.204
6M							0.100	0.252
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)
0.860	+0.010	37,723.91	+568.58	142.85-87	143.62-64
日付	9/12	9/13	9/17	9/18	9/19
日銀当預残	5,425,000	5,418,400	5,421,900	5,421,300	5,441,000
準備預金残	4,853,900	4,857,600	4,876,500	4,883,000	4,899,900
マネタリーベース	6,666,500	6,660,000	6,663,300	6,662,300	6,681,900
無担O/N加重平均	0.229%	0.227%	0.228%	0.228%	0.227%
コール市場残高	118,621	120,728	115,425	114,970	115,394
うち無担	79,240	80,391	74,925	74,914	75,147
うちO/N	32,493	33,674	32,815	32,684	33,117
うち有担	39,381	40,337	40,500	40,056	40,247

## ●入札結果

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/20	2024/9/24	▲0.050	16,007	16,007		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/20	2024/9/24	▲0.050	3,815	3,815		▲0.050	▲0.050	

## ●日銀 金融政策決定会合・結果

### ●当面の金融政策運営について

- 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(全員一致)。  
無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0.25%程度で推移するよう促す。

## ●2024年9月24日の予定

\*7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数  
\*9月の米CB消費者信頼感指数

\*流動性供給入札  
(5,000億円、9/25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