Central Daily Market Report

2024年9月24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24日 需給速報	2024年9月25日 需給予想	2024年9月26日 当社予想
銀行券	▲ 100	200	▲ 500
財政	7,200	1,400	▲ 1,000
資金過不足	7,100	1,600	▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入				▲ 400		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 20,400	19,400		20,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	6,100		21,400		▲ 1,500	

当座預金残高	5,486,000	5,507,400	5,505,900
準備預金残高	4,930,700		
積み終了先	4,928,900		
超過準備	4,928,900		
非準備預金先	555,300		

9月25日以降の残り所要積立額	
積数	12,700
1日平均	600

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	99.68%	日数 30.00%

●2024年9月24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、引き続き邦銀勢からの旺盛な資金調達ニーズを背景に、0.225～0.227%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、0.235～0.25%程度での出合いとなった。
SC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>
24日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2024/9/24	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	0.220	0.227	0.226				－	0.219
T/N							－	0.235
S/N							－	－
1W							－	0.201
2W							－	0.200
3W							－	0.199
1M			0.310				－	0.199
3M	0.335	0.345	0.343				0.050	0.205
6M							0.090	0.251
1Y							0.225	0.317

JGB新発10年債	
直近値	前日比
0.805	▲ 0.055

日経平均株価	
15時時点	前日比
37,940.59	+216.68

ドル/円	
為替（9時）	為替（17時）
143.61-63	144.44-47

日付	9/13	9/17	9/18	9/19	9/20
日銀当預残	5,418,400	5,421,900	5,421,300	5,441,000	5,479,900
準備預金残	4,857,600	4,876,500	4,883,000	4,899,900	4,942,500
マネタリーベース	6,660,000	6,663,300	6,662,300	6,681,900	6,721,000
無担O/N加重平均	0.227%	0.228%	0.228%	0.227%	0.226%
コール市場残高	120,728	115,425	114,970	115,394	118,236
うち無担	80,391	74,925	74,914	75,147	77,587
うちO/N	33,674	32,815	32,684	33,117	34,997
うち有担	40,337	40,500	40,056	40,247	40,649

●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)
流動性供給	414	－	5,000	2024/9/25	－	19,036	4,995		▲0.041%	90.0804%		▲0.043%	

●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		2024/9/26	2024/10/3	5.080	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/9/24	2024/9/25	▲ 0.050	20,803	20,803		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/24	2024/9/25	▲ 0.050	20	20		▲0.050	▲0.050	

●2024年9月25日の予定

*8月の企業向けサービス価格指数　　*8月の米新築一戸建て販売件数

◆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ものがあります。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