

Central Daily Market Report

2024年9月25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25日 需給速報	2024年9月26日 需給予想	2024年9月27日 当社予想
銀行券	300	▲ 100	▲ 500
財政	▲ 1,600	2,900	▲ 18,000
資金過不足	▲ 1,300	2,800	▲ 18,500

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			13,400			
CP等買入		▲ 400		▲ 500		
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		▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 15,800	20,400		15,800		
当預増減	2,700		31,300		▲ 18,500	

当座預金残高	5,488,700	5,520,000	5,501,500	
準備預金残高	4,943,300			
積み終了先	4,941,300			
超過準備	4,941,300			
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	99.73%	日数	33.33%

●2024年9月25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、0.225~0.25%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>

25日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施された。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。
CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.270%、平均レート0.334%と前回(按分0.299%、平均0.344%)比で、按分レート、平均レート共に低下した。

●短期金融市場関連指標

2024/9/25	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	0.227	0.226					-	0.243
T/N								-	0.229
S/N								-	-
1W	0.290	0.320	0.297					-	0.200
2W								-	0.200
3W								-	0.199
1M								-	0.199
3M								0.050	0.205
6M								0.090	0.251
1Y								0.224	0.317

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)
0.810	+0.005	37,870.26	▲ 70.33	142.94-97	143.89-90
日付	9/17	9/18	9/19	9/20	9/24
日銀当預残	5,421,900	5,421,300	5,441,000	5,479,900	5,486,000
準備預金残	4,876,500	4,883,000	4,899,900	4,942,500	4,930,700
マネタリーベース	6,663,300	6,662,300	6,681,900	6,721,000	6,727,200
無担O/N加重平均	0.228%	0.228%	0.227%	0.226%	0.226%
コール市場残高	115,425	114,970	115,394	118,236	121,885
うち無担	74,925	74,914	75,147	77,587	76,618
うちO/N	32,815	32,684	33,117	34,997	34,398
うち有担	40,500	40,056	40,247	40,649	45,267

●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	応募総額 (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	2024/9/26			9,191	3,501	▲0.010		▲0.009	100.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,750	2024/9/26			9,118	3,754	▲0.009		▲0.007	42.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2024/9/26			6,943	4,003	▲0.007		▲0.002	55.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/9/26			2,055	1,500	▲0.010		0.001	33.3
国債買入(物価連動債)	600	2024/9/26			1,955	601	0.240		0.145	83.2
CP等買入	4,000	2024/9/30			5,255	3,995	0.270		0.334	53.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/25	2024/9/26	▲0.050	16,006	16,006		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/25	2024/9/26	▲0.050	0	0				

●2024年9月26日の予定

*金融政策決定会合議事要旨
(7月30、31日分)

*4-6月期の米GDP確報値
*8月の米耐久財新規受注

*40年利付国債入札
(7,000億円、9/27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