

●資金需給

単位：億円	2024年9月26日 需給速報		2024年9月27日 需給予想		2024年9月30日 当社予想	
銀行券	▲ 200		400		1,100	
財政	▲ 1,300		▲ 14,800		11,700	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 14,400		12,800	
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		▲ 500		▲ 200	4,000	
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 15,300	15,800		15,300		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	11,700		700		16,800	
当座預金残高	5,500,400		5,501,100		5,517,900	
準備預金残高	4,961,900		9月27日以降の残り所要積立額 積数 8,600 1日平均 500			
積み終了先	4,960,400					
超過準備	4,959,800					
非準備預金先	538,500					
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 99.78%		日数		36.67%	

●2024年9月26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、0.215~0.245%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＞

26日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP市場は月末発行にあたり、幅広い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。

●短期金融市場関連指標

2024/9/26	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				-	0.241
T/N							-	0.219
S/N							-	-
1W							-	0.201
2W							-	0.199
3W							-	0.199
1M							-	0.199
3M			0.395				0.050	0.206
6M							0.090	0.251
1Y							0.190	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)
0.830	+0.020	38,925.63	+1,055.37	144.71-73	145.01-03
日付					
9/18		9/19	9/20	9/24	9/25
日銀当預残		5,421,300	5,441,000	5,479,900	5,486,000
準備預金残		4,883,000	4,899,900	4,942,500	4,930,700
マネタリーベース		6,662,300	6,681,900	6,721,000	6,727,200
無担O/N加重平均		0.228%	0.227%	0.226%	0.226%
コール市場残高		114,970	115,394	118,236	121,885
うち無担		74,914	75,147	77,587	76,618
うちO/N		32,684	33,117	34,997	34,398
うち有担		40,056	40,247	40,649	45,267

●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1非面 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
40年利付国債	17	2.2%	7,000	2024/9/27	2064/3/20	18,043	6,994	96.40	2.340%	58.1749%				

●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)		2024/9/26	2024/9/27	▲0.050	15,395	15,395		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/26	2024/9/27	▲0.050	143	143		▲0.050	▲0.050	

●2024年9月27日の予定

*9月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.0%) *7月の景気動向指数改訂状況	*8月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1259回)入札 (3ヶ月、46,000億円、9/30発行)
--	---------------------	---

◆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