

Central Daily Market Report

2024年9月27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27日 需給速報		2024年9月30日 需給予想		2024年10月1日 当社予想	
銀行券	300		500		700	
財政	▲ 17,500		13,500		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 17,200		14,000		▲ 22,300	
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		▲ 200	4,000	▲ 3,100		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 15,300	15,300		15,300		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 17,400		30,200		▲ 22,300	
当座預金残高	5,483,000		5,513,200		5,490,900	
準備預金残高	4,946,400		9月30日以降の残り所要積立額 積数 5,000 1日平均 300			
積み終了先	4,945,400					
超過準備	4,945,200					
非準備預金先	536,600					
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 99.87%		日数 46.67%			

●2024年9月27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、0.185～0.255%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＞
27日はTB3M物（第1259回）の入札が実施され、事前予想に対し甘く、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、案分レート近辺で出会いが見られた。この他、1Y物でも少額出会いが見られた。

＜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

2024/9/27	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	0.228	0.226				－	0.244
T/N							－	0.208
S/N							－	－
1W							－	0.199
2W			0.320				－	0.198
3W							－	0.198
1M	0.295	0.330	0.308				－	0.199
3M			0.320				0.030	0.207
6M			0.570				0.080	0.249
1Y							0.180	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）
0.805	▲ 0.025	39,829.56	+903.93	145.04-07	143.18-21

日付	9/19	9/20	9/24	9/25	9/26
日銀当預残	5,441,000	5,479,900	5,486,000	5,488,700	5,500,400
準備預金残	4,899,900	4,942,500	4,930,700	4,943,300	4,961,900
マネタリーベース	6,681,900	6,721,000	6,727,200	6,729,600	6,741,500
無担O/N加重平均	0.227%	0.226%	0.226%	0.226%	0.226%
コール市場残高	115,394	118,236	121,885	116,998	113,661
うち無担	75,147	77,587	76,618	71,912	72,159
うちO/N	33,117	34,997	34,398	30,232	30,364
うち有担	40,247	40,649	45,267	45,086	41,502

●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）
国庫短期証券	1259	－	46,000	2024/9/30	2025/1/8	94,546	34,922	99.9900	0.0365%	72.0000%	99.9987	0.0047%	11,078

●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）		2024/9/27	2024/9/30	▲0.050	15,645	15,645		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/27	2024/9/30	▲0.050	0	0				

●2024年9月30日の予定

*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比▲0.9%）	*9月のシカゴPM景況感指数	*2年利付国債入札 （26,000億円、10/1発行）
*8月の商業動態統計速報	*4-6月期の英GDP確報値	
*8月の住宅着工統計		

◆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