

●資金需給

単位：億円	2024年9月2日 需給速報		2024年9月3日 需給予想		2024年9月4日 当社予想	
銀行券	600		700		700	
財政	▲ 22,100		▲ 24,300		▲ 54,000	
資金過不足	▲ 21,500		▲ 23,600		▲ 53,300	
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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金（成）		▲ 1,500				
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 15,200	16,000		15,200		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 22,500		▲ 8,700		▲ 61,300	
当座預金残高	5,481,900		5,473,200		5,411,900	
準備預金残高	4,902,900		9月3日以降の残り所要積立額 積数 700 1日平均 100			
積み終了先	4,902,800					
超過準備	4,902,800					
非準備預金先	579,000					
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額					4,070,500	
準備預金進捗率	実績 99.98%		日数		58.06%	

●2024年9月2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、出合いの水準に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズを背景に、0.226～0.228%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、0.235～0.245%程度での出合いとなった。
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＞
2日のアウトライト市場は動意なく閑散中、1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、数件の発行が実施された。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

2024/9/2	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	0.215	0.228	0.227				－	0.244
T/N							－	0.233
S/N							－	－
1W			0.227				－	0.187
2W							－	0.187
3W			0.350				－	0.186
1M							－	0.184
3M							0.090	0.201
6M							0.100	0.253
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)
0.905	+0.015	38,700.87	+53.12	146.40-42	146.47-48

日付	8/26	8/27	8/28	8/29	8/30
日銀当預残	5,505,800	5,503,400	5,497,200	5,498,600	5,504,400
準備預金残	4,940,300	4,937,600	4,937,000	4,928,700	4,911,400
マネタリーベース	6,750,000	6,747,700	6,741,500	6,743,300	6,748,700
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%
コール市場残高	114,109	115,504	115,030	117,428	118,652
うち無担	74,298	77,326	76,575	79,880	81,634
うちO/N	33,041	35,649	33,708	36,523	39,047
うち有担	39,811	38,178	38,455	37,548	37,018

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札 （億円）
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）		2024/9/2	2024/9/3	▲0.050	15,468	15,468		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/2	2024/9/3	▲0.050	0	0				

●2024年9月3日の予定

*8月のマネタリーベース	*7月の米建設支出	*10年利付国債入札
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*8月のISM製造業景況指数	(26,000億円、9/4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よう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