

Central Daily Market Report

2024年9月3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3日 需給速報		2024年9月4日 需給予想		2024年9月5日 当社予想	
銀行券	700		200		▲ 100	
財政	▲ 30,400		▲ 25,200		1,000	
資金過不足	▲ 29,700		▲ 25,000		900	
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	▲ 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)						
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	▲ 16,500	15,200		16,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 31,300		▲ 8,500		900	
当座預金残高	5,450,600		5,442,100		5,443,000	
準備預金残高	4,878,000					
積み終了先	4,877,900		9月4日以降の残り所要積立額 積数 700 1日平均 100			
超過準備	4,877,900					
非準備預金先	572,600					
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		61.29%	

●2024年9月3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から、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。

＜レボ市場＞

GC T/Nは、0.235～0.250%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＞

3日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜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

2024/9/3	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京 レボレート
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	0.215	0.229	0.227				－	0.240
T/N							－	0.237
S/N							－	－
1W							－	0.191
2W							－	0.189
3W							－	0.187
1M			0.320				－	0.184
3M							0.100	0.201
6M							0.100	0.253
1Y							0.265	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)
0.920	+0.015	38,686.31	▲ 14.56	146.75-76	145.93-96

日付	8/27	8/28	8/29	8/30	9/2
日銀当預残	5,503,400	5,497,200	5,498,600	5,504,400	5,481,900
準備預金残	4,937,600	4,937,000	4,928,700	4,911,400	4,902,900
マネタリーベース	6,747,700	6,741,500	6,743,300	6,748,700	6,725,600
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高	115,504	115,030	117,428	118,652	115,775
うち無担	77,326	76,575	79,880	81,634	77,956
うちO/N	35,649	33,708	36,523	39,047	35,809
うち有担	38,178	38,455	37,548	37,018	37,819

●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1非償 格競争入 札（億円）	非競争 入札（億 円）
10年利付国債	375	1.1%	26,000	2024/9/4	2034/6/20	62,928	19,842	101.57	0.925%	14.4285%	101.66	0.915%	6,139	13.47

●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		2024/9/5	2024/9/12	5.580	1	1				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/9/3	2024/9/4	▲0.050	16,827	16,827		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2024/9/4	2024/9/18	0.250	11,806	8,004				67.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/3	2024/9/4	▲0.050	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2024/9/4	2024/9/13	0.220	2	2		0.220	0.220	

●2024年9月4日の予定

*9月の日銀当座預金増減要因見込み	*7月の米貿易収支 *7月の米製造業新規受注・出荷・在庫 *米ページブック
-------------------	---

◆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