

●資金需給

単位：億円	2024年9月4日 需給速報		2024年9月5日 需給予想		2024年9月6日 当社予想	
銀行券	100		300		▲ 300	
財政	▲ 27,800		▲ 800		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 27,700		▲ 500		▲ 9,300	
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	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,700			
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				▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 16,100	16,500		16,100		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 27,300		24,100		▲ 9,300	
当座預金残高	5,423,300		5,447,400		5,438,100	
準備預金残高	4,864,200					
積み終了先	4,864,100				9月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,864,100				積数	600
非準備預金先	559,100				1日平均	100
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		99.99%	日数	64.52%	

●2024年9月4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。

＜レポ市場＞
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＞
4日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出合いが見られた。

＜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

2024/9/4	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	0.213	0.229	0.227				－	0.243
T/N							－	0.237
S/N							－	－
1W			0.228				－	0.191
2W			0.300				－	0.190
3W							－	0.189
1M	0.300	0.490	0.373				－	0.184
3M			0.350				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）
0.884	▲ 0.036	37,047.61	▲ 1,638.70	145.38-40	144.99-01

日付	8/28	8/29	8/30	9/2	9/3
日銀当預残	5,497,200	5,498,600	5,504,400	5,481,900	5,450,600
準備預金残	4,937,000	4,928,700	4,911,400	4,902,900	4,878,000
マネタリーベース	6,741,500	6,743,300	6,748,700	6,725,600	6,693,600
無担O/N加重平均	0.227%	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	115,030	117,428	118,652	115,775	117,244
うち無担	76,575	79,880	81,634	77,956	77,759
うちO/N	33,708	36,523	39,047	35,809	35,612
うち有担	38,455	37,548	37,018	37,819	39,485

●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
国債買入（残存期間1年以下）	1,500	2024/9/5			3,236	1,501	▲0.007		0.001	43.1
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,500	2024/9/5			12,142	3,501	▲0.004		▲0.002	9.2
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,750	2024/9/5			11,880	3,757	▲0.020		▲0.018	91.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/9/4	2024/9/5	▲0.050	16,469	16,469		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/4	2024/9/5	▲0.050	0	0				

●2024年9月5日の予定

*石川県金融経済懇談会において 高田日銀審議委員講演 *7月の毎月勤労統計調査速報	*8月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札 （9,000億円、9/6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