

Central Daily Market Report

2024年9月5日(木)

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5日 需給速報	2024年9月6日 需給予想	2024年9月9日 当社予想
銀行券	200	300	1,000
財政	2,200	▲ 6,800	9,000
資金過不足	2,400	▲ 6,500	10,000

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	8,700					
CP等買入		▲ 100		▲ 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		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 15,800	16,100		15,800		
※ F T F資金供給用国債補充供給						
当預増減	11,200		9,100		10,000	

当座預金残高	5,434,500	5,443,600	5,453,600	
準備預金残高	4,868,300			
積み終了先	4,868,200		9月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,868,200		積数	500
非準備預金先	566,200		1日平均	0
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	67.74%

●短期金融市場関連指標

2024/9/5	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	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	0.228	0.227				-	0.246
T/N							-	0.239
S/N							-	-
1W							-	0.193
2W							-	0.193
3W							-	0.192
1M			0.325				-	0.192
3M							0.100	0.201
6M							0.100	0.253
1Y							0.260	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)		
0.870	▲ 0.014	36,657.09	▲ 390.52	143.32-34	143.60-62		
日付	8/29	8/30	9/2	9/3	9/4		
日銀当預残	5,498,600	5,504,400	5,481,900	5,450,600	5,423,300		
準備預金残	4,928,700	4,911,400	4,902,900	4,878,000	4,864,400		
マネタリーベース	6,743,300	6,748,700	6,725,600	6,693,600	6,666,200		
無担O/N加重平均	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%		
コール市場残高	117,428	118,652	115,775	117,244	113,295		
うち無担	79,880	81,634	77,956	77,759	75,165		
うちO/N	36,523	39,047	35,809	35,612	32,618		
うち有担	37,548	37,018	37,819	39,485	38,130		

●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)
30年利付国債	83	2.2%	9,000	2024/9/6	2054/6/20	23,093	6,796	102.70	2.053%	70.8463%	102.90	2.043%	2,195

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/5	2024/9/6	▲0.050	16,154	16,154		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/5	2024/9/6	▲0.050	0	0				

●2024年9月6日の予定

*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*8月の米雇用統計	*国庫短期証券(1254回)
*7月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.2%)	*4-6月期のユーロ圏GDP確報値	(3ヶ月、46,000億円、9/9発行)
*7月の景気動向指数速報		

◆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場合があります。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