

# Central Daily Market Report

2024年9月6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6日 需給速報	2024年9月9日 需給予想	2024年9月10日 当社予想
銀行券	300	600	500
財政	▲ 9,400	8,600	7,000
資金過不足	▲ 9,100	9,200	7,500

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			6,200			
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		▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 14,700	15,800		14,700		
※ F T F資金供給用国債補充供給						
当預増減	▲ 8,200		29,700		7,500	

当座預金残高	5,426,300	5,456,000	5,463,500	
準備預金残高	4,862,600			
積み終了先	4,862,500			
超過準備	4,862,500			
非準備預金先	563,700			
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			4,071,500	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	77.42%

## ●短期金融市場関連指標

2024/9/6	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	売買参考値	平均値
O/N	0.215	0.228	0.227				-	0.243
T/N							-	0.241
S/N							-	-
1W							-	0.198
2W							-	0.198
3W							-	0.196
1M	0.300	0.330	0.320				-	0.194
3M							0.078	0.203
6M							0.100	0.254
1Y							0.260	0.319

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)
0.845	▲ 0.025	36,391.47	▲ 265.62	143.34-37	142.51-54
日付	8/30	9/2	9/3	9/4	9/5
日銀当預残	5,504,400	5,481,900	5,450,600	5,423,300	5,434,500
準備預金残	4,911,400	4,902,900	4,878,000	4,864,400	4,868,300
マネタリーベース	6,748,700	6,725,600	6,693,600	6,666,200	6,677,100
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	118,652	115,775	117,244	113,295	116,807
うち無担	81,634	77,956	77,759	75,165	76,560
うちO/N	39,047	35,809	35,612	32,618	33,613
うち有担	37,018	37,819	39,485	38,130	40,247

## ●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	1254	-	46,000	2024/9/9	2024/12/9	145,609	34,686.7	99,979.5	0.0822%	83.1090%	99.9806	0.0778%	11,313

## ●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5年超10年以下)	4,000	2024/9/9			8,341	4,006	0.002		0.004	10.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/9/9			2,461	1,504	0.005		0.008	99.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/9/9			1,611	753	0.003		0.005	11.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/9/6	2024/9/9	▲0.050	15,005	15,005		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/9/6	2024/9/9	▲0.050	0	0				

## ●2024年9月9日の予定

*4-6月期のGDP 2次速報(市場予想:前期比年率+3.2%)	*7月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1255回)入札(6ヶ月、35,000億円、9/10発行)
*7月の国際収支	*7月の米消費者信用残高	
*8月の景気ウォッチャー調査		

◆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

## ●2024年9月6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、0.240~0.250%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>

6日はTB3M物(第1254回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、強含みで推移した。

### <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。