

Central Daily Market Report

2023年8月1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	2023年8月1日 需給速報	2023年8月2日 需給予想	2023年8月3日 当社予想			
銀行券	100	600	▲ 500			
財政	▲ 25,100	▲ 91,300	2,000			
資金過不足	▲ 25,000	▲ 90,700	1,500			
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			5,000	▲ 9,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入	3,200					
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 49,500	50,900		49,500		
※下り資金供給用担保確保債						
当預増減	▲ 19,400	▲ 45,200				1,500
当座預金残高	5,408,700	5,363,500				5,365,000
準備預金残高	4,713,300					
積み終了先	4,712,000				8月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,711,700				積数	10,300
非準備預金先	695,400				1日平均	700
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						4,015,900
準備預金進捗率	実績	99.74%			日数	54.84%

●2023年8月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.08~▲0.05%近辺で出合いが見られた。足もとではオファーサイドの資金運用ニーズが増加しているなか、ビッドサイドには慎重な姿勢を取る先も多い事からレートは低下した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.09%程度での出合いとなった。SC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>

1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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/8/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.091	0.590	▲ 0.010	33,476.58	304.36	142.31-33	142.71-73
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.065				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.065	▲ 0.035	▲ 0.056				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.120						
3M			0.028				▲ 0.105	▲ 0.128						
6M							▲ 0.175	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.101						
日付	7/25	7/26	7/27	7/28	7/31									
日銀当預残	5,397,300	5,391,400	5,398,900	5,405,700	5,428,100									
準備預金残	4,695,300	4,692,800	4,693,200	4,699,800	4,728,800									
マネタリーベース	6,656,800	6,651,000	6,659,500	6,666,700	6,688,600									
無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.073%	▲0.071%	▲0.059%	▲0.061%									
コール市場残高	178,921	179,868	194,086	189,503	195,122									
うち無担	147,873	148,124	163,002	158,099	165,241									
うちO/N	71,740	69,686	87,164	85,411	97,588									
うち有担	31,048	31,744	31,084	31,404	29,881									

●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非償還募入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	371	0.400%	27,000	2023/8/2	2033/6/20	79,301.0	21,809.0	98,100.0	0.6030%	51.8727%	98,180.0	0.5940%	5,173	14,14

●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(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/8/2		0.400	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/8/2		0.610	0	0				
米ドル資金供給		2023/8/3	2023/8/10	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/1	2023/8/2	▲0.350	50,128	50,128		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/8/2	2023/8/16	0.000	5,000	5,000				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/1	2023/8/2	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り、国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。
※1固定利回較差の結果、10年利付国債371回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。※2固定利回較差の結果、10年利付国債360回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2023年8月2日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(6月15・16日分)	*7月のマネタリーベース	*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
--------------------------	--------------	----------------------

◆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ものがあります。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