

# Central Daily Market Report

2023年8月2日(水)

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2日 需給速報	2023年8月3日 需給予想	2023年8月4日 当社予想			
銀行券	600	▲ 800	▲ 300			
財政	▲ 92,400	2,000	▲ 2,500			
資金過不足	▲ 91,800	1,200	▲ 2,800			
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						
国債買入			18,100			
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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 42,400	49,500		42,400		
当預増減	▲ 88,700	61,600		▲ 2,800		
当座預金残高	5,320,000	5,381,600		5,378,800		
準備預金残高	4,645,200					
積み終了先	4,644,100			8月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,644,100			積数	9,200	
非準備預金先	674,800			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	99.77%		日数	58.06%	

## ●2023年8月2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~▲0.06%近辺で出合いが見られた。引き続き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、▲0.10~▲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>

2日のアウトライ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た。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

2023/8/2	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	▲ 0.070				-	▲ 0.092	0.625	0.035	32,707.69	▲ 768.89	142.95-97	142.63-65
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.111						
3W			0.001				-	▲ 0.115						
1M			0.001				-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.105	▲ 0.128						
6M							▲ 0.175	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.101						
									日付	7/26	7/27	7/28	7/31	8/1
									日銀当預残	5,391,400	5,398,900	5,405,700	5,428,100	5,408,700
									準備預金残	4,692,800	4,693,200	4,699,800	4,728,800	4,709,700
									マネタリーベース	6,651,000	6,659,500	6,666,700	6,688,600	6,669,000
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.071%	▲0.059%	▲0.061%	▲0.063%
									コール市場残高	179,868	194,086	189,503	195,122	186,353
									うち無担	148,124	163,002	158,099	165,241	156,358
									うちO/N	69,686	87,164	85,411	97,588	89,215
									うち有担	31,744	31,084	31,404	29,881	29,995

## ●入札結果

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(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/8/3		0.410	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		2023/8/3		0.635	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/8/3			10,843	4,258	0.005		0.006	66.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/8/3			7,355	4,503	0.011		0.013	77.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/8/3			14,568	6,755	0.012		0.013	71.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/8/3			3,660	2,008	0.015		0.018	75.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/8/3			2,695	1,000	0.017		0.019	20.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/2	2023/8/3	▲0.350	42,806	42,806		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/2	2023/8/3	▲0.350	79	79		▲0.350	▲0.350	

\*オペの種類が、国債補充供給(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3日の予定

\*8月の日銀当座預金増減要因見込み

\*英中銀MPC結果発表  
\*7月のISM非製造業景況指数  
\*6月の米製造業新規受注・出荷・在庫

\*10年物価連動国債  
(2,500億円、8/4発行)  
\*交付税特別会計借入  
(12,000億円、8/15借入)

◆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