

Central Daily Market Report

2023年8月3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	2023年8月3日 需給速報	2023年8月4日 需給予想	2023年8月7日 当社予想			
銀行券	▲ 800	200	1,000			
財政	1,600	▲ 400	3,000			
資金過不足	800	▲ 200	4,000			
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	18,100		4,200			
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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 39,000	42,400	39,000			
当預増減	22,200	42,900	4,000			
当座預金残高	5,342,200	5,385,100	5,389,100			
準備預金残高	4,666,300					
積み終了先	4,665,000			8月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,665,000			積数	7,900	
非準備預金先	675,900			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	99.80%	日数	61.29%		

●2023年8月3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~▲0.07%近辺で出合いが見られた。一部の先から試し取りが行われたが、その要因を除くと、レートは全般的に前日比で低下した。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、▲0.105~▲0.10%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>

3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、発行レートは横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2023/8/3	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		
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	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					-	▲ 0.094	0.650	0.025	32,159.28	▲ 548.41	143.33-35	142.89-91
T/N								-	▲ 0.101						
S/N			▲ 0.055					-	-						
1W	▲ 0.058	▲ 0.048	▲ 0.053					-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.045	0.020	▲ 0.018					-	▲ 0.109						
3W								-	▲ 0.114						
1M	▲ 0.010	0.250	0.072					-	▲ 0.119						
3M								▲ 0.105	▲ 0.128						
6M								▲ 0.175	▲ 0.129						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.101						
										日付	7/27	7/28	7/31	8/1	8/2
										日銀当預残	5,398,900	5,405,700	5,428,100	5,408,700	5,320,000
										準備預金残	4,693,200	4,699,800	4,728,800	4,709,700	4,645,200
										マネタリーベース	6,659,500	6,666,700	6,688,600	6,669,000	6,579,700
										無担O/N加重平均	▲0.071%	▲0.059%	▲0.061%	▲0.063%	▲0.070%
										コール市場残高	194,086	189,503	195,122	186,353	181,044
										うち無担	163,002	158,099	165,241	156,358	151,067
										うちO/N	87,164	85,411	97,588	89,215	83,909
										うち有担	31,084	31,404	29,881	29,995	29,977

●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非価格競争入札(億円)
物債連動10年	28	0.005%	2,500	2023/8/4	2033/3/10	7,263.0	2,499.0	105.2000	▲0.5100%	82.3529%			
交付税特会	-	-	12,000	2023/8/15	2024/2/15	467,494.0	12,000.52		0.0000%	2.5670%		0.0000%	

●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		2023/8/4		0.375	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		2023/8/4		0.605	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/3	2023/8/4	▲0.350	39,458	39,458		▲0.350	▲0.352	
国債買入(残存期間3年超5年以下)	1,000	2023/8/4			1,510	1,000	0.013		0.020	30.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/8/4			7,191	3,005	0.016		0.020	67.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/3	2023/8/4	▲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4日の予定

*7月の米雇用統計	*国庫短期証券(1173回)入札 (3ヶ月、58,000億円、8/7発行)
-----------	--

◆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