

Central Daily Market Report

2023年8月10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10日 需給速報	2023年8月14日 需給予想	2023年8月15日 当社予想			
銀行券	▲ 600	400	1,000			
財政	15,400	200	68,000			
資金過不足	14,800	600	69,000			
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	17,500					
CP等買入		▲ 800			4,000	
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				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 29,100	29,800		29,100		
※下引資金供給総額(国債買入)						
当預増減	32,100	29,700	73,000			
当座預金残高	5,383,600	5,413,300	5,486,300			
準備預金残高	4,694,900					
積み終了先	4,694,900		8月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,694,600		積数	0		
非準備預金先	688,700		1日平均	0		
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			4,017,300			
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	93.55%		

●2023年8月10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▲0.085~▲0.070%近辺で出合いが見られた。オファーサイドの一部に運用ニーズの減退が見られた一方で、ビッドサイドでは、週末要因や積み最終日に向けた調整から、取り上がる動きが見られた事もあり、レート水準は小幅上昇した。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、▲0.11~▲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>

10日はTB3M物(第1175回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/8/10	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	▲ 0.072					-	▲ 0.098	0.585	0.020	32,473.65	269.32	143.70-72	143.80-81
T/N								-	▲ 0.101						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.107						
2W								-	▲ 0.112						
3W								-	▲ 0.116						
1M			▲ 0.033					-	▲ 0.124						
3M								▲ 0.119	▲ 0.122						
6M								▲ 0.162	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.100						
										日付	8/3	8/4	8/7	8/8	8/9
										日銀当預残	5,342,200	5,350,600	5,359,500	5,360,500	5,351,500
										準備預金残	4,666,300	4,663,700	4,676,900	4,657,700	4,645,400
										マネタリーベース	6,602,600	6,610,800	6,619,300	6,620,600	6,612,000
										無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.072%	▲0.075%	▲0.073%	▲0.074%
										コール市場残高	177,832	177,207	167,673	174,413	181,750
										うち無担	146,719	146,775	136,399	143,460	150,699
										うちO/N	78,406	77,642	67,946	74,407	82,346
										うち有担	31,113	30,432	31,274	30,953	31,051

●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)
国庫短期証券	1175	-	58,000	2023/8/14	2023/11/13	145,846.0	46,876.4	100.0260	▲0.1042%	82.4313%	100.0277	▲0.1110%	11,123.0

●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		2023/8/14		0.435	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		2023/8/14		0.641	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/10	2023/8/14	▲0.350	29,398	29,398		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/10	2023/8/14	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.360	

*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11日の予定

*山の日	*7月の米生産者物価指数 *8月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *4-6月期の英GDP速報値
------	---

●2023年8月14日の予定

*特にありません

◆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