

Central Daily Market Report

2023年8月28日(月)
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28日 需給速報	2023年8月29日 需給予想	2023年8月30日 当社予想			
銀行券	400	▲ 100	500			
財政	▲ 900	▲ 1,800	▲ 3,700			
資金過不足	▲ 500	▲ 1,900	▲ 3,200			
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						▲ 7,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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	▲ 29,600	28,800		29,600		
当預増減	▲ 1,400		27,500		▲ 10,500	
当座預金残高	5,467,800		5,495,300		5,484,800	
準備預金残高	4,757,100					
積み終了先	4,755,200			8月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,755,200			積数	14,700	
非準備預金先	710,700			1日平均	800	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額						4,009,600
準備預金進捗率	実績	99.63%	日数	41.94%		

●2023年8月28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、邦銀業態からの調達を中心に▲0.07~▲0.06%近辺での出会いとなった。週末3日積み要因は剥落したものの、地銀業態を中心にしっかりとした調達意欲が見られたため、前週末と比べやや上昇した水準での取引となった。ターム物はショートターム物での出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.17~▲0.145%程度での出会いとなった。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>

28日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会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。CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート▲0.005%、平均レート+0.001%と前回(按分▲0.002%、平均+0.006%)比で、按分、平均ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2023/8/28	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.135	0.660	0.005	32,169.99	545.71	146.53-55	146.53-55
T/N							-	▲ 0.163						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.162						
2W	▲ 0.060	0.030	▲ 0.023				-	▲ 0.157						
3W							-	▲ 0.153						
1M			▲ 0.009				-	▲ 0.158						
3M							▲ 0.300	▲ 0.141						
6M							▲ 0.147	▲ 0.125						
1Y							▲ 0.092	▲ 0.092						
									日付	8/21	8/22	8/23	8/24	8/25
									日銀当預残	5,445,600	5,440,300	5,438,700	5,450,400	5,469,200
									準備預金残	4,747,900	4,737,000	4,734,700	4,750,100	4,758,300
									マネタリーベース	6,704,700	6,699,400	6,697,600	6,710,000	6,728,800
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.061%
									コール市場残高	185,580	192,361	193,372	195,803	196,246
									うち無担	157,597	164,616	165,193	168,889	168,803
									うちO/N	78,624	82,683	83,360	86,536	85,650
									うち有担	27,983	27,745	28,179	26,914	27,443

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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		2023/8/29		0.345	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		2023/8/29		0.585	0	0				
CP等買入	4,000	2023/8/31			7,275	3,999	▲0.005		0.001	31.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/28	2023/8/29	▲0.350	29,996	29,996		▲0.350	▲0.353	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/28	2023/8/29	▲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29日の予定

*7月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(29,000億円、9/1発行)
*7月の有効求人倍率(市場予想:1.3倍)	*8月の米CB消費者信頼感指数	

◆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