

Central Daily Market Report

2023年8月30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30日 需給速報	2023年8月31日 需給予想	2023年9月1日 当社予想			
銀行券	0	0	▲ 100			
財政	▲ 1,000	1,700	▲ 35,000			
資金過不足	▲ 1,000	1,700	▲ 35,100			
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	8,800	▲ 7,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入		14,800				
CP等買入		4,000	▲ 2,000			
貸出支援基金(成)						▲ 1,900
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 100	▲ 300			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 28,400	28,900	28,400			
当預増減	1,900	46,600	▲ 37,000			
当座預金残高	5,468,700	5,515,300	5,478,300			
準備預金残高	4,751,700					
積み終了先	4,749,800			8月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,749,800			積数	11,000	
非準備預金先	717,000			1日平均	700	
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	99.73%	日数	48.39%		

●2023年8月30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▲0.06~▲0.05%近辺での出会いとなった。引き続き地銀業態を中心に調達意欲は旺盛で、一部取り上がる先も見られた事から、レート水準は前日比でやや上昇した。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、▲0.20~▲0.15%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>

30日のアウトラ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、数件の入札が実施された。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

2023/8/30	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	▲ 0.052					-	▲ 0.164	0.650	0.010	32,333.46	106.49	145.97-99	146.37-39
T/N								-	▲ 0.204						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.058	▲ 0.059					-	▲ 0.179						
2W	▲ 0.055	▲ 0.042	▲ 0.051					-	▲ 0.167						
3W								-	▲ 0.163						
1M	▲ 0.030	▲ 0.009	▲ 0.021					-	▲ 0.163						
3M								▲ 0.300	▲ 0.144						
6M								▲ 0.147	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.097	▲ 0.092						
日付		8/23	8/24	8/25	8/28	8/29									
日銀当預残		5,438,700	5,450,400	5,469,200	5,467,800	5,466,800									
準備預金残		4,734,700	4,750,100	4,758,300	4,757,100	4,761,500									
マネタリーベース		6,697,600	6,710,000	6,728,800	6,727,100	6,726,200									
無担O/N加重平均		▲0.064%	▲0.063%	▲0.061%	▲0.060%	▲0.055%									
コール市場残高		193,372	195,803	196,246	197,950	201,576									
うち無担		165,193	168,889	168,803	173,064	174,710									
うちO/N		83,360	86,536	85,650	89,881	95,527									
うち有担		28,179	26,914	27,443	24,886	26,866									

●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)
交付税特会	-	-	11,450	2023/9/8	2024/3/8	434,413	11,450.58		0.000%	2.6359%		0.000%	

●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		2023/8/31		0.360	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		2023/8/31		0.606	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/8/31			8,995	4,505	0.005		0.006	80.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/8/31			12,650	6,758	0.000		0.003	96.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/8/31			3,244	2,004	0.010		0.011	90.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/8/31			1,899	1,003	0.011		0.013	58.3
国債買入(物価連動債)	600	2023/8/31			2,121	600	▲0.070		▲0.293	39.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/30	2023/8/31	▲0.450	28,679	28,679		▲0.450	▲0.452	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/30	2023/8/31	▲0.450	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31日の予定

●岐阜県金融経済懇話会において中村日銀審議委員講演	*7月の米個人所得・消費支出(PCE)
●7月の商業動態統計速報	*7月の住宅着工統計
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲1.4%)	*8月のシカゴPM景況感指数
	*8月のユーロ圏消費者物価指数速報値

◆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