Central Daily Market Report

2023年8月31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31日 需給速報		2023年9月1日 需給予想		2023年9月4日 当社予想	
銀行券	0		600		1,000	
財政	▲ 300		▲ 34,700		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 300		▲ 34,100		▲ 22,000	
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	14,800					
CP等買入	4,000	▲ 2,000		▲ 100		
貸出支援基金（成）				▲ 3,700		
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 100		
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 28,400	28,400		28,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	16,200		▲ 9,600		▲ 22,000	

当座預金残高	5,484,900	5,475,300	5,453,300
準備預金残高	4,764,600		
積み終了先	4,763,100		
超過準備	4,762,900		
非準備預金先	720,300		

9月1日以降の残り所要積立額	
積数	9,300
1日平均	600

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	99.77%	日数 51.61%

●2023年8月31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▲0.075～▲0.05%近辺での出合いとなった。月末要因により、ビッドサイドの一部に調達を控える動きが見られた事で、下限レートが切り下がった一方で、引き続き積極的な調達を行った先もあり、結果として全体的なレート水準は小幅な低下に留まった。ターム物はショートターム物での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.19～▲0.15%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>

31日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、入札件数が少なく閑散としたマーケットとなった。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

2023/8/31	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.056				－	▲ 0.161
T/N							－	▲ 0.164
S/N							－	－
1W	▲ 0.060	▲ 0.013	▲ 0.040				－	▲ 0.162
2W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.045				－	▲ 0.158
3W	▲ 0.053	0.001	▲ 0.035				－	▲ 0.158
1M	▲ 0.060	▲ 0.030	▲ 0.045				－	▲ 0.162
3M							▲ 0.300	▲ 0.142
6M							▲ 0.147	▲ 0.123
1Y							▲ 0.100	▲ 0.092

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.645	▲ 0.005	32,619.34	285.88	146.07-09	145.90-92

日付	8/24	8/25	8/28	8/29	8/30
日銀当預残	5,450,400	5,469,200	5,467,800	5,466,800	5,468,700
準備預金残	4,750,100	4,758,300	4,757,100	4,761,500	4,751,700
マネタリーベース	6,710,000	6,728,800	6,727,100	6,726,200	6,728,100
無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.061%	▲0.060%	▲0.055%	▲0.052%
コール市場残高	195,803	196,246	197,950	201,576	208,295
うち無担	168,889	168,803	173,064	174,710	183,529
うちO/N	86,536	85,650	89,881	95,527	106,631
うち有担	26,914	27,443	24,886	26,866	24,766

●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Ⅰ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		2023/9/1		0.350	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		2023/9/1		0.595	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2023/8/31	2023/9/1	▲0.450	28,605	28,605		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2023/8/31	2023/9/1	▲0.450	117	117		▲0.450	▲0.450	

*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9月1日の予定

*4-6月期の法人企業統計調査季報
*8月の米雇用統計
*7月の米建設支出
*8月のISM製造業景況指数
*国庫短期証券(1179回)入札
（3ヶ月、58,000億円、9/4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論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