

Central Daily Market Report

2023年9月1日(金)

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9月1日 需給速報	2023年9月4日 需給予想	2023年9月5日 当社予想			
銀行券	600	1,000	1,000			
財政	▲ 36,500	▲ 23,200	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 35,900	▲ 22,200	0			
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
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		▲ 100		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 32,900	28,400		32,900		
当預増減	▲ 44,300		10,100			0
当座預金残高	5,440,600		5,450,700			5,450,700
準備預金残高	4,730,600					
積み終了先	4,729,500			9月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,729,400			積数	5,700	
非準備預金先	710,000			1日平均	500	
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	99.86%	日数	61.29%		

●2023年9月1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~▲0.05%近辺での出会いとなった。月末要因が剥落し、週末3日積みとなった事でビット数は回復した。しかし、オファーサイドに運用ニーズの高まりが見られた事で、ギブン地合いとなった結果、レート水準は若干低下して推移した。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、▲0.16~▲0.10%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>

1日はTB3M物(第1179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、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

2023/9/1	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	
	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	▲ 0.060				-	▲ 0.148	0.625	▲ 0.020	32,710.62	91.28	145.48-50	145.41-43
T/N							-	▲ 0.152						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.033				-	▲ 0.155						
2W	▲ 0.070	0.030	▲ 0.035				-	▲ 0.157						
3W			0.001				-	▲ 0.158						
1M							-	▲ 0.165						
3M							▲ 0.165	▲ 0.143						
6M							▲ 0.147	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.100	▲ 0.092						
									日付	8/25	8/28	8/29	8/30	8/31
									日銀当預残	5,469,200	5,467,800	5,466,800	5,468,700	5,484,900
									準備預金残	4,758,300	4,757,100	4,761,500	4,751,700	4,764,600
									マネタリーベース	6,728,800	6,727,100	6,726,200	6,728,100	6,744,200
									無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.060%	▲0.055%	▲0.052%	▲0.056%
									コール市場残高	196,246	197,950	201,576	208,295	189,724
									うち無担	168,803	173,064	174,710	183,529	162,395
									うちO/N	85,650	89,881	95,527	106,631	92,427
									うち有担	27,443	24,886	26,866	24,766	27,329

●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	1179	-	58,000	2023/9/4	2023/12/4	121,597.9	46,886.3	100.0375	▲0.1503%	14.5437%	100.0415	▲0.1663%	11,113

●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		2023/9/4		0.355	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		2023/9/4		0.600	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/9/4		0.570	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/1	2023/9/4	▲0.450	32,431	32,431		▲0.450	▲0.451	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/1	2023/9/4	▲0.450	851	851		▲0.450	▲0.450	

*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。※3固定利回較差の結果、10年利付国債361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4日の予定

*8月のマネタリーベース

*New York祝日(Labor Day)

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み

◆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