

Central Daily Market Report

2023年9月4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9月4日 需給速報	2023年9月5日 需給予想	2023年9月6日 当社予想			
銀行券	1,000	600	500			
財政	▲ 24,400	▲ 300	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 23,400	300	▲ 26,500			
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		11,400				
CP等買入		▲ 500	▲ 300			
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						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 35,400	32,900	35,400			
当預増減	▲ 26,500	46,800	▲ 26,500			
当座預金残高	5,414,100	5,460,900	5,434,400			
準備預金残高	4,723,300					
積み終了先	4,721,700			9月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,721,700			積数	4,000	
非準備預金先	690,800			1日平均	400	
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	99.90%	日数	64.52%		

●2023年9月4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~▲0.060%近辺での出会いとなった。
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、▲0.12~▲0.105%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>

4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。

●短期金融市場関連指標

2023/9/4	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	▲ 0.069					-	▲ 0.107	0.640	0.015	32,939.18	228.56	146.05-07	146.40-41
T/N			▲ 0.060					-	▲ 0.114						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.038					-	▲ 0.135						
2W	▲ 0.068	0.030	▲ 0.049					-	▲ 0.137						
3W			0.001					-	▲ 0.142						
1M	0.005	0.150	0.027					-	▲ 0.160						
3M								▲ 0.165	▲ 0.141						
6M								▲ 0.147	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.100	▲ 0.093						
										日付	8/28	8/29	8/30	8/31	9/1
										日銀当預残	5,467,800	5,466,800	5,468,700	5,484,900	5,440,600
										準備預金残	4,757,100	4,761,500	4,751,700	4,764,600	4,730,600
										マネタリーベース	6,727,100	6,726,200	6,728,100	6,744,200	6,699,300
										無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.055%	▲0.052%	▲0.056%	▲0.060%
										コール市場残高	197,950	201,576	208,295	189,724	199,654
										うち無担	173,064	174,710	183,529	162,395	175,041
										うちO/N	89,881	95,527	106,631	92,427	104,703
										うち有担	24,886	26,866	24,766	27,329	24,613

●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		2023/9/5		0.375	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		2023/9/5		0.620	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		2023/9/5		0.590	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/9/5			6,725	4,250	▲0.002		0.000	72.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/9/5			7,524	4,501	0.002		0.010	4.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/9/5			4,483	2,004	0.025		0.027	80.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/9/5			1,458	1,001	0.020		0.026	57.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/4	2023/9/5	▲0.450	35,762	35,762		▲0.450	▲0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/4	2023/9/5	▲0.450	0	0				

*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5日の予定

*9月の日銀当座預金増減要因見込み	*7月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(27,000億円、9/6発行)
*7月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.5%)		

◆本資料は信頼できるとさ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