

Central Daily Market Report

2023年9月5日(火)

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5日 需給速報	2023年9月6日 需給予想	2023年9月7日 当社予想			
銀行券	600	100	100			
財政	300	▲ 24,800	▲ 1,000			
資金過不足	900	▲ 24,700	▲ 900			
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		1,000				
国債買入	11,400					
CP等買入		▲ 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						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 35,300	35,400	35,300			
当預増減	12,100	11,600	▲ 900			
当座預金残高	5,426,200	5,437,800	5,436,900			
準備預金残高	4,722,600					
積み終了先	4,722,000					
超過準備	4,721,500					
非準備預金先	703,600					
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	99.93%	日数	67.74%		

●2023年9月5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▲0.078~▲0.070%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~▲0.095%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>

5日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットで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た。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/9/5	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	▲ 0.072				-	▲ 0.107	0.655	0.015			146.53-55	146.90-93
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.115						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.073	0.000	▲ 0.060				-	▲ 0.129						
2W	▲ 0.065	▲ 0.060	▲ 0.063				-	▲ 0.135						
3W							-	▲ 0.141						
1M			0.270				-	▲ 0.165						
3M							▲ 0.165	▲ 0.141						
6M							▲ 0.147	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.100	▲ 0.093						
									日付	8/29	8/30	8/31	9/1	9/4
									日銀当預残	5,466,800	5,468,700	5,484,900	5,440,600	5,414,100
									準備預金残	4,761,500	4,751,700	4,764,600	4,730,600	4,722,200
									マネタリーベース	6,726,200	6,728,100	6,744,200	6,699,300	6,671,800
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.052%	▲0.056%	▲0.060%	▲0.069%
									コール市場残高	201,576	208,295	189,724	199,654	199,296
									うち無担	174,710	183,529	162,395	175,041	169,172
									うちO/N	95,527	106,631	92,427	104,703	93,544
									うち有担	26,866	24,766	27,329	24,613	30,124

●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	371	0.400%	27,000	2023/9/6	2033/6/20	87,307	21,722	97.53	0.668%	74.9127%	97.63	0.657%	5,258	13,977

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/9/6			7,774	1,001	0.008		0.008	86.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/9/6		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		2023/9/6		0.605	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		2023/9/6		0.575	0	0				
米ドル資金供給		2023/9/7	2023/9/14	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/5	2023/9/6	▲0.350	35,715	35,715		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/5	2023/9/6	▲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。※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6日の予定

*山口県金融経済懇談会において高田日銀審議委員講演

*8月のISM非製造業景況指数

*7月の米貿易収支

*米ページブック

◆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