

Central Daily Market Report

2023年9月7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9月7日 需給速報	2023年9月8日 需給予想	2023年9月11日 当社予想			
銀行券	▲ 100	400	▲ 600			
財政	▲ 1,400	▲ 15,900	12,000			
資金過不足	▲ 1,500	▲ 15,500	11,400			
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		▲ 400		▲ 200		
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		▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 29,700	28,700		29,700		
当預増減	▲ 3,000	13,800		11,400		
当座預金残高	5,402,300	5,416,100		5,427,500		
準備預金残高	4,709,400					
積み終了先	4,708,900			9月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,708,900			積数	1,800	
非準備預金先	692,900			1日平均	200	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額				4,018,100		
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	74.19%		

●2023年9月7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~▲0.068%近辺での出合いとなった。
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、▲0.105~▲0.095%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>

7日はTB6M物(第1180回)の入札が実施され、テールの流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかり推移した。

<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。

●2023年9月8日の予定

- *4-6月期のGDP 2次速報(市場予想:前期比年率+5.5%)
- *7月の特定サービス産業動態統計速報
- *8月の景気ウォッチャー調査
- *7月の国際収支
- *7月の毎月勤労統計調査速報
- *7月の米消費者信用残高
- *7月の米卸売売上高
- *国庫短期証券(1181回)入札(3ヶ月、56,000億円、9/11発行)

●短期金融市場関連指標

2023/9/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート 平均値	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			直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
単位:%							売買参考統計値		0.655	0.005	32,991.08	▲249.94	147.71-73	147.43-45
O/N	▲0.087	0.001	▲0.072				-	▲0.100						
T/N							-	▲0.106						
S/N							-	-						
1W	▲0.070	0.001	▲0.036				-	▲0.122						
2W	▲0.070	0.030	▲0.045				-	▲0.129						
3W							-	▲0.140						
1M							-	▲0.162						
3M							▲0.165	▲0.138						
6M							▲0.160	▲0.126						
1Y							▲0.100	▲0.093						
日付		8/31	9/1	9/4	9/5	9/6								
日銀当預残	5,484,900	5,440,600	5,414,100	5,426,200	5,405,300									
準備預金残	4,764,600	4,730,600	4,722,200	4,718,000	4,711,600									
マネタリーベース	6,744,200	6,699,300	6,671,800	6,683,300	6,662,400									
無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.060%	▲0.069%	▲0.072%	▲0.076%									
コール市場残高	189,724	199,654	199,296	202,113	189,220									
うち無担	162,395	175,041	169,172	173,963	158,837									
うちO/N	92,427	104,703	93,544	92,655	76,254									
うち有担	27,329	24,613	30,124	28,150	30,383									

●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	棄分率	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	1180	-	40,000	2023/9/11	2024/3/11	123,507	32,380.6	100.073	▲0.1462%	21.9744%	100.080	▲0.1603%	7,619
30年利付国債	79	1.20%	9,000	2023/9/8	2053/6/20	25,087	7,249	90.90	1.656%	11.5720%	91.18	1.640%	1,747
エネルギー対策	-	-	6,200	2023/9/20	2024/9/20	132,400	6,199.95		0.000%	4.6829%		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		2023/9/8		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		2023/9/8		0.595	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		2023/9/8		0.565	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/7	2023/9/8	▲0.350	30,114	30,114		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/7	2023/9/8	▲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。

◆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