

Central Daily Market Report

2023年8月9日(水)

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9日 需給速報	2023年8月10日 需給予想	2023年8月14日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 600	▲ 500			
財政	▲ 10,100	15,900	3,500			
資金過不足	▲ 10,600	15,300	3,000			
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	1,000					
国債買入		17,500				
CP等買入		▲ 100	▲ 800			
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 29,800	30,500	29,800			
当増減	▲ 9,000	61,700	3,000			
当座預金残高	5,351,500	5,413,200	5,416,200			
準備預金残高	4,643,800					
積み終了先	4,643,300			8月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,643,200			積数	1,300	
非準備預金先	707,700			1日平均	200	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額				4,017,300		
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	80.65%		

●2023年8月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.087~▲0.075%近辺で出合いが見られた。出合いのレンジは前日から概ね横ばいとなったものの、オファーサイドの一部に積極的な運用ニーズが見られた事で、中心的なレート水準は低下基調となった。
ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.11%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>

9日はTB6M物(第1174回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、無難に推移した。

<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。
CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート▲0.002%、平均レート+0.006%と前回(按分0.000%、平均+0.005%)比で、按分は低下し、平均は上昇した。

●短期金融市場関連指標

2023/8/9	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	▲ 0.074					-	▲ 0.103	0.565	▲ 0.040	32,204.33	▲ 172.96	143.24-27	143.24-26
T/N	▲ 0.080	▲ 0.060	▲ 0.076					-	▲ 0.147						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.133						
2W			▲ 0.065					-	▲ 0.127						
3W								-	▲ 0.126						
1M								-	▲ 0.135						
3M								▲ 0.105	▲ 0.124						
6M								▲ 0.162	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.100						
日付		8/2	8/3	8/4	8/7	8/8									
日銀当預残		5,320,000	5,342,200	5,350,600	5,359,500	5,360,500									
準備預金残		4,645,200	4,666,300	4,663,700	4,676,900	4,657,700									
マネタリーベース		6,579,700	6,602,600	6,610,800	6,619,300	6,620,600									
無担O/N加重平均		▲0.070%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.075%	▲0.073%									
コール市場残高		181,044	177,832	177,207	167,673	174,413									
うち無担		151,067	146,719	146,775	136,399	143,460									
うちO/N		83,909	78,406	77,642	67,946	74,407									
うち有担		29,977	31,113	30,432	31,274	30,953									

●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	1174	-	40,000	2023/8/10	2024/2/13	117,269.0	32,968.8	100.0730	▲0.1423%	63.6834%	100.0830	▲0.1618%	7,031.0
エネルギー対策	-	-	6,677	2023/8/21	2024/8/20	134,340.0	6,676.96		0.0000%	4.9703%		0.0000%	

●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		2023/8/10		0.395	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		2023/8/10		0.600	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/8/10			8,807	4,255	▲0.004		▲0.003	67.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/8/10			8,380	4,505	▲0.014		▲0.011	48.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/8/10			10,524	6,756	▲0.028		▲0.025	81.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/8/10			3,683	2,004	▲0.032		▲0.030	91.4
CP等買入	4,000	2023/8/15			8,768	4,001	▲0.002		0.006	46.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/9	2023/8/10	▲0.350	30,198	30,198		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/9	2023/8/10	▲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。

●2023年8月10日の予定

*7月の企業物価指数	*7月の米消費者物価指数	*国庫短期証券(1175回)入札
*6月の特定サービス産業動態統計速報	*7月の米財政収支	(3ヶ月、58,000億円、8/14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、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