

Central Daily Market Report

2023年8月23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23日 需給速報	2023年8月24日 需給予想	2023年8月25日 当社予想			
銀行券	200	▲ 700	▲ 500			
財政	▲ 6,600	3,800	1,500			
資金過不足	▲ 6,400	3,100	1,000			
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			10,800			
CP等買入				▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 27,600	31,400		27,600		
当増預減	▲ 1,600	41,300		1,000		
当座預金残高	5,438,700	5,480,000		5,481,000		
準備預金残高	4,734,700					
積み終了先	4,732,200			8月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,732,200			積数	24,100	
非準備預金先	704,000			1日平均	1,000	
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	99.40%		日数	25.81%	

●2023年8月23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~▲0.065%近辺での出会いとなった。出会いレンジは横這い圏での推移となったが、中心は僅かに上昇する展開となった。出会い一巡後もビッドは多く残り、▲0.07%近辺で散発的な出会いが見られた。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、▲0.15~▲0.14%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>

23日のアウトラ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発行市場は五・十日発行にあたり、複数の業態から発行が実施され、一部の業態からは大型発行も見られた。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

2023/8/23	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	売買参考統計値	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	▲ 0.064					-	▲ 0.111	0.674	0.009	32,010.26	153.55	145.77-79	145.38-40
T/N								-	▲ 0.153						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.068	▲ 0.069					-	▲ 0.137						
2W			▲ 0.063					-	▲ 0.136						
3W			▲ 0.062					-	▲ 0.141						
1M								-	▲ 0.147						
3M								▲ 0.130	▲ 0.132						
6M								▲ 0.142	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.079	▲ 0.092						
										日付	8/16	8/17	8/18	8/21	8/22
										日銀当預残	5,435,700	5,454,900	5,441,400	5,445,600	5,440,300
										準備預金残	4,742,900	4,758,100	4,745,100	4,747,900	4,737,000
										マネタリーベース	6,695,900	6,714,900	6,701,000	6,704,700	6,699,400
										無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.065%	▲0.064%
										コール市場残高	158,126	170,911	183,606	185,580	192,361
										うち無担	128,932	141,888	155,644	157,597	164,616
										うちO/N	63,714	70,565	78,351	78,624	82,683
										うち有担	29,194	29,023	27,962	27,983	27,745

●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		2023/8/24		0.335	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		2023/8/24		0.560	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/8/24			6,384	4,257	▲0.004		▲0.003	87.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/8/24			11,305	4,505	0.001		0.001	99.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/8/24			4,844	2,005	▲0.002		0.005	58.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/23	2023/8/24	▲0.350	28,014	28,014		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/23	2023/8/24	▲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24日の予定

*ジャクソンホール会議(26日まで)	*流動性供給入札(5,000億円、8/25発行)	*交付税特別会計借入(12,000億円、9/4借入)
*7月の米耐久財新規受注		

◆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