

Central Daily Market Report

2023年8月24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8月24日 需給速報	2023年8月25日 需給予想	2023年8月28日 当社予想			
銀行券	▲ 700	100	500			
財政	4,200	18,100	11,000			
資金過不足	3,500	18,200	11,500			
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	10,800					
CP等買入		▲ 200		▲ 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				▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 30,000	27,600		30,000		
当預増減	11,700	47,600	11,500			
当座預金残高	5,450,400	5,498,000	5,509,500			
準備預金残高	4,750,000					
積み終了先	4,747,600			8月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,747,600			積数	21,700	
非準備預金先	700,400			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	99.46%	日数	29.03%		

●2023年8月24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▲0.073~▲0.065%近辺での出会いとなった。オファー、ビッド共に大きな変化はなく、レート水準は前日から横這い圏での推移となった。出会い巡後も▲0.07%近辺で出会いが散見された。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、▲0.14~▲0.13%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>

24日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2023/8/24	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	▲ 0.063					-	▲ 0.115	0.645	▲ 0.029	32,287.21	276.95	144.68-70	145.31-33
T/N								-	▲ 0.149						
S/N			▲ 0.065					-	-						
1W	▲ 0.072	▲ 0.069	▲ 0.071					-	▲ 0.142						
2W			▲ 0.065					-	▲ 0.141						
3W								-	▲ 0.144						
1M								-	▲ 0.148						
3M								▲ 0.130	▲ 0.133						
6M								▲ 0.142	▲ 0.125						
1Y								▲ 0.085	▲ 0.091						
										日付	8/17	8/18	8/21	8/22	8/23
										日銀当預残	5,454,900	5,441,400	5,445,600	5,440,300	5,438,700
										準備預金残	4,758,100	4,745,100	4,747,900	4,737,000	4,734,700
										マネタリーベース	6,714,900	6,701,000	6,704,700	6,699,400	6,697,600
										無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.065%	▲0.064%	▲0.064%
										コール市場残高	170,911	183,606	185,580	192,361	193,372
										うち無担	141,888	155,644	157,597	164,616	165,193
										うちO/N	70,565	78,351	78,624	82,683	83,360
										うち有担	29,023	27,962	27,983	27,745	28,179

●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)
流動性供給	388	-	5,000	2023/8/25	-	14,520	4,997		▲0.031%	28.9156%		▲0.038%	
交付税特会	-	-	12,000	2023/9/4	2024/3/5	446,081	12,000.25		0.000%	2.6902%		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		2023/8/25		0.326	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		2023/8/25		0.560	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/24	2023/8/25	▲0.450	30,452	30,452		▲0.450	▲0.454	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/24	2023/8/25	▲0.450	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25日の予定

*8月の都区部消費者物価指数(CPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.9%)
*7月の企業向けサービス価格指数

*国庫短期証券(1178回)入札
(3ヶ月、58,000億円、8/28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