

Central Daily Market Report

2023年8月29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8月29日 需給速報	2023年8月30日 需給予想	2023年8月31日 当社予想			
銀行券	▲ 200	0	▲ 600			
財政	▲ 1,300	▲ 2,300	4,500			
資金過不足	▲ 1,500	▲ 2,300	3,900			
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			8,800	▲ 7,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200			4,000	
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	▲ 28,900	29,600		28,900		
当預増減	▲ 1,000	29,000	7,900			
当座預金残高	5,466,800	5,495,800	5,503,700			
準備預金残高	4,761,300					
積み終了先	4,759,600			8月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,759,600			積数	12,900	
非準備預金先	705,500			1日平均	800	
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	99.68%	日数	45.16%		

●2023年8月29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~▲0.05%近辺での出会いとなった。引き続き、地銀業態を中心に積極的な調達が見られ、前日対比でやや上昇した水準での取引となった。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、▲0.18~▲0.16%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>

29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、無難な結果となった。マーケットでは1Y物に出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、月末にあたり複数の業態が発行に動くなか、一部では大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●2023年8月30日の予定

- *道東地域金融経済懇談会において田村日銀審議委員講演
- *8月の消費動向調査
- *4-6月期の米GDP改定値
- *交付税特別会計借入(11,450億円、9/8借入)

●短期金融市場関連指標

2023/8/29	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	▲ 0.055					-	▲ 0.122	0.640	▲ 0.020	32,226.97	56.98	146.46-47	146.45-47
T/N								-	▲ 0.161						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.055	▲ 0.061					-	▲ 0.163						
2W	▲ 0.060	0.001	▲ 0.023					-	▲ 0.160						
3W								-	▲ 0.158						
1M			▲ 0.020					-	▲ 0.160						
3M								▲ 0.300	▲ 0.142						
6M								▲ 0.147	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.097	▲ 0.092						
日付	8/22	8/23	8/24	8/25	8/28										
日銀当預残	5,440,300	5,438,700	5,450,400	5,469,200	5,467,800										
準備預金残	4,737,000	4,734,700	4,750,100	4,758,300	4,757,100										
マネタリーベース	6,699,400	6,697,600	6,710,000	6,728,800	6,727,100										
無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.061%	▲0.060%										
コール市場残高	192,361	193,372	195,803	196,246	197,950										
うち無担	164,616	165,193	168,889	168,803	173,064										
うちO/N	82,683	83,360	86,536	85,650	89,881										
うち有担	27,745	28,179	26,914	27,443	24,886										

●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)
2年利付国債	452	0.005%	29,000	2023/9/1	2025/9/1	75,138	23,437	99.970	0.0200%	91.2993%	99.987	0.011%	5,556

●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	2023/8/30			4,598	1,000	0.005		0.011	0.5
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/8/30		0.340	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		2023/8/30		0.585	0	0				
米ドル資金供給		2023/8/31	2023/9/7	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/29	2023/8/30	▲0.450	29,314	29,314		▲0.450	▲0.451	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/8/30	2023/9/13	0.000	8,831	8,831				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/29	2023/8/30	▲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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特別第37期(借り換え)	2023/9/5		2,034	19
成長基盤強化	米ドル特別第33期(借り換え)	2023/9/5		3,348	23

◆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よう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