

Central Daily Market Report

2023年9月8日(金)

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8日 需給速報	2023年9月11日 需給予想	2023年9月12日 当社予想			
銀行券	300	1,000	600			
財政	▲ 16,100	8,400	▲ 2,000			
資金過不足	▲ 15,800	9,400	▲ 1,400			
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		17,500				
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	▲ 200		▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 24,400	29,700	24,400			
当預増減	▲ 10,900	50,900	▲ 1,400			
当座預金残高	5,391,400	5,442,300	5,440,900			
準備預金残高	4,696,900					
積み終了先	4,696,500			9月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,696,500			積数	500	
非準備預金先	694,500			1日平均	100	
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	99.99%	日数	83.87%		

●2023年9月8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▲0.070~▲0.060%近辺での出会いとなった。
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、▲0.10~▲0.09%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>

8日はTB3M物(第1181回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりと推移した。

<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。
本日は、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。結果は按分落札レート▲0.003%、平均落札レート+0.008%と前回(按分落札レート▲0.005%・平均落札レート+0.001%)比で按分・平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2023/9/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.096	0.645	▲ 0.010	32,606.84	▲ 384.24	147.32-33	147.38-41
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.068	▲ 0.040	▲ 0.061				-	▲ 0.116						
2W			▲ 0.069				-	▲ 0.125						
3W	▲ 0.025	▲ 0.005	▲ 0.017				-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.162						
3M							▲ 0.148	▲ 0.137						
6M							▲ 0.160	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.100	▲ 0.093						
日付		9/1	9/4	9/5	9/6	9/7								
日銀当預残		5,440,600	5,414,100	5,426,200	5,405,300	5,402,300								
準備預金残		4,730,600	4,722,200	4,718,000	4,711,600	4,709,500								
マネタリーベース		6,699,300	6,671,800	6,683,300	6,662,400	6,659,400								
無担O/N加重平均		▲0.060%	▲0.069%	▲0.072%	▲0.076%	▲0.072%								
コール市場残高		199,654	199,296	202,113	189,220	185,662								
うち無担		175,041	169,172	173,963	158,837	156,664								
うちO/N		104,703	93,544	92,655	76,254	74,066								
うち有担		24,613	30,124	28,150	30,383	28,998								

●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	1181	-	56,000	2023/9/11	2023/12/11	141,552	45,262.8	100.0340	▲0.1363%	54.2060%	100.0372	▲0.1491%	10,737

●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		2023/9/11		0.345	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		2023/9/11		0.594	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		2023/9/11		0.560	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/9/11			6,112	4,254	▲0.008		▲0.005	93.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/9/11			12,292	4,504	▲0.015		▲0.014	26.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/9/11			13,663	6,760	▲0.020		▲0.017	52.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/9/11			4,079	2,006	▲0.018		▲0.013	71.2
CP等買入	4,000	2023/9/13			7,530	4,000	▲0.003		0.008	12.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/8	2023/9/11	▲0.350	24,811	24,811		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/8	2023/9/11	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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。

●2023年9月11日の予定

*8月のマネーストック

◆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