

Central Daily Market Report

2023年8月15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15日 需給速報	2023年8月16日 需給予想	2023年8月17日 当社予想			
銀行券	200	500	▲ 500			
財政	68,700	▲ 26,600	▲ 4,000			
資金過不足	68,900	▲ 26,100	▲ 4,500			
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			7,300	▲ 5,000		
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	4,000	▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 31,900	38,000		31,900		
当預増減	78,700	9,000		▲ 4,500		
当座預金残高	5,457,700	5,466,700		5,462,200		
準備預金残高	4,781,500					
積み終了先	4,781,500			8月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,781,500			積数	4,009,600	
非準備預金先	676,200			1日平均	129,300	
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	0.00%		日数	0.00%	

●2023年8月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢からの調達を中心に▲0.05~▲0.01%近辺での出会いとなった。積み最終日となったが、各業態からの調達ニーズは非常に強く、レート水準は前日に比べ大きく上昇した。出会い一巡後も、ビットが多く残る中、▲0.03~▲0.01%近辺で出会いが散見された。ターム物は目立った出会いが見られず閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲0.10%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>

15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、やや弱めの結果となった。マーケットで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

2023/8/15	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	▲ 0.029					-	▲ 0.097	0.625	0.010	32,238.89	178.98	145.43-45	145.80-81
T/N								-	▲ 0.107						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.068	▲ 0.015	▲ 0.062					-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.013					-	▲ 0.111						
3W			▲ 0.060					-	▲ 0.118						
1M			▲ 0.035					-	▲ 0.124						
3M			0.035					▲ 0.119	▲ 0.122						
6M								▲ 0.162	▲ 0.133						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.100						
										日付	8/7	8/8	8/9	8/10	8/14
										日銀当預残	5,359,500	5,360,500	5,351,500	5,383,600	5,379,000
										準備預金残	4,676,900	4,657,700	4,645,400	4,694,900	4,722,600
										マネタリーベース	6,619,300	6,620,600	6,612,000	6,644,800	6,639,800
										無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.072%	▲0.068%
										コール市場残高	167,673	174,413	181,750	170,836	180,311
										うち無担	136,399	143,460	150,699	139,904	149,977
										うちO/N	67,946	74,407	82,346	69,601	81,824
										うち有担	31,274	30,953	31,051	30,932	30,334

●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I非競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	160	0.200%	25,000	2023/8/16	2028/6/20	67,557.0	20,190.0	100.0200	0.1950%	33.7977%	100.0500	0.1890%	4,793	10.00

●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	2023/8/16			4,794	1,003	0.011		0.011	49.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/8/16		0.385	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		2023/8/16		0.586	0	0				
米ドル資金供給		2023/8/17	2023/8/24	5.580	1	1				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/15	2023/8/16	▲0.350	32,396	32,396		▲0.350	▲0.376	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/8/16	2023/8/30	0.000	7,250	7,250				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/15	2023/8/16	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/8/16	2023/8/25		2	2		▲0.100	▲0.100	

*オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上取期間利回り。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16日の予定

*7月の米住宅着工件数	*4-6月期のユーロ圏GDP2次速報	*国有林野借入
*7月の米鉱工業生産・設備稼働率	*7月の英消費者物価指数	(961億円、8/25借入)

◆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