

# Central Daily Market Report

2023年8月16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16日 需給速報	2023年8月17日 需給予想	2023年8月18日 当社予想			
銀行券	500	100	▲ 300			
財政	▲ 26,100	7,200	▲ 13,000			
資金過不足	▲ 25,600	7,300	▲ 13,300			
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			13,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
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						
国債補完供給	▲ 31,500	31,900		31,500		
当預増減	▲ 22,000	51,700		▲ 13,300		
当座預金残高	5,435,700	5,487,400		5,474,100		
準備預金残高	4,742,900					
積み終了先	2,987,300			8月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,309,300			積数	576,000	
非準備預金先	692,800			1日平均	19,200	
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	85.63%		日数	3.23%	

## ●2023年8月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.07~▲0.055%近辺での出合いとなった。積み初日となり、レート目線が定まり辛いなか、朝方は▲0.06~▲0.055%近辺で多くの出合いが見られた。出合い一巡後もオファーサイドの運用ニーズが継続された事で、レート水準はやや低下する展開となった。  
ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.12~▲0.105%程度での出合いとなった。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>

16日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は一部の業態で大型発行が実施された。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

2023/8/16	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			
	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	▲ 0.060				-	▲ 0.098	0.625	0.000	31,766.82	▲ 472.07	145.60-62	145.36-38		
T/N							-	▲ 0.120								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.064	▲ 0.058	▲ 0.061				-	▲ 0.115			日付	8/8	8/9	8/10	8/14	8/15
2W	▲ 0.063	▲ 0.045	▲ 0.054				-	▲ 0.116			日銀当預残	5,360,500	5,351,500	5,383,600	5,379,000	5,457,700
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.119			準備預金残	4,657,700	4,645,400	4,694,900	4,722,600	4,781,500
1M							-	▲ 0.126			マネタリーベース	6,620,600	6,612,000	6,644,800	6,639,800	6,718,300
3M							▲ 0.120	▲ 0.125			無担O/N加重平均	▲ 0.073%	▲ 0.074%	▲ 0.072%	▲ 0.068%	▲ 0.029%
6M							▲ 0.162	▲ 0.129			コール市場残高	174,413	181,750	170,836	180,311	162,722
1Y							▲ 0.120	▲ 0.100			うち無担	143,460	150,699	139,904	149,977	134,076
											うちO/N	74,407	82,346	69,601	81,824	68,658
											うち有担	30,953	31,051	30,932	30,334	28,646

## ●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)
国有林野借入	-	-	961	2023/8/25	2028/8/25	4,445.0	961.00		0.1830%	68.7826%		0.1660%	

## ●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		2023/8/17		0.375	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		2023/8/17		0.585	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/8/17			8,126	1,503	0.006		0.006	73.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/8/17			8,107	4,255	0.000		0.002	27.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/8/17			9,880	6,756	▲0.002		0.003	21.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/8/17			1,610	1,001	0.005		0.008	15.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/16	2023/8/17	▲0.350	31,975	31,975		▲0.350	▲0.364	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/16	2023/8/17	▲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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第21回	2023/8/18	2025/8/18	0

## ●2023年8月17日の予定

*6月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+3.6%)	*7月の貿易統計 *6月の第3次産業活動指数	*国庫短期証券(1176回)入札 (1年、35,000億円、8/21発行)	*20年利付国債入札 (12,000億円、8/18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			