

# Central Daily Market Report

2023年8月25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8月25日 需給速報	2023年8月28日 需給予想	2023年8月29日 当社予想			
銀行券	0	400	▲ 500			
財政	18,200	200	▲ 4,000			
資金過不足	18,200	600	▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
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	▲ 28,800	30,000		28,800		
当預増減	18,800	29,300		▲ 4,500		
当座預金残高	5,469,200	5,498,500		5,494,000		
準備預金残高	4,758,300					
積み終了先	4,756,600			8月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,756,600			積数	16,600	
非準備預金先	710,900			1日平均	900	
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	99.59%		日数	38.71%	

## ●2023年8月25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~▲0.06%近辺での出会いとなった。週末3日積みとなり、ビッドサイドの一部から調達ニーズの高まりが見られた事で、レート水準は前日に比べ若干上昇し、の推移となった。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、▲0.14~▲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>

25日はTB3M物(第1178回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2023/8/25	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	▲ 0.061				-	▲ 0.108	0.655	0.010	31,624.28	▲ 662.93	146.04-06	146.05-07
T/N							-	▲ 0.129						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.035	▲ 0.058				-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.064	▲ 0.020	▲ 0.059				-	▲ 0.132						
3W							-	▲ 0.133						
1M			0.180				-	▲ 0.139						
3M							▲ 0.300	▲ 0.133						
6M							▲ 0.147	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.092	▲ 0.091						
日付	8/18	8/21	8/22	8/23	8/24									
日銀当預残	5,441,400	5,445,600	5,440,300	5,438,700	5,450,400									
準備預金残	4,745,100	4,747,900	4,737,000	4,734,700	4,750,100									
マネタリーベース	6,701,000	6,704,700	6,699,400	6,697,600	6,710,000									
無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.065%	▲ 0.064%	▲ 0.064%	▲ 0.063%									
コール市場残高	183,606	185,580	192,361	193,372	195,803									
うち無担	155,644	157,597	164,616	165,193	168,889									
うちO/N	78,351	78,624	82,683	83,360	86,536									
うち有担	27,962	27,983	27,745	28,179	26,914									

## ●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	1178	-	58,000	2023/8/28	2023/11/27	188,110	46,601.8	100.0370	▲0.1483%	81.7578%	100.037	▲0.1483%	11,398

## ●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		2023/8/28		0.355	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		2023/8/28		0.595	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/25	2023/8/28	▲0.350	29,250	29,250		▲0.350	▲0.363	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/25	2023/8/28	▲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。

## ●2023年8月28日の予定

\*月例経済報告  
\*6月の景気動向指数改訂状況

\*London祝日(SummerBankHoliday)

◆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