

Central Daily Market Report

2023年8月14日(月)
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14日 需給速報	2023年8月15日 需給予想	2023年8月16日 当社予想			
銀行券	400	100	500			
財政	3,900	69,600	▲ 27,000			
資金過不足	4,300	69,700	▲ 26,500			
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						▲ 5,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入			4,000	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 38,000	29,100		38,000		
当預増減	▲ 4,600		111,400		▲ 31,500	
当座預金残高	5,379,000		5,490,400		5,458,900	
準備預金残高	4,721,400					
積み終了先	4,721,400			8月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,721,300			積数		0
非準備預金先	657,600			1日平均		0
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						4,017,300
準備預金進捗率	実績	100.00%		日数		96.77%

●2023年8月14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▲0.075~▲0.07%近辺での出合いが始まった。積み最終日を明日に控え、各業態から着地に向けた資金調達ニーズが強まったことでレートは上昇した。一巡後もビッドを継続する先が複数見られた。ターム物は目立った出合いが見られず閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.12~▲0.09%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>

14日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<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

2023/8/14	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.108	0.615	0.030	32,059.91	▲ 413.74	144.86-87	144.79-81	
T/N							-	▲ 0.107							
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.111							
2W	▲ 0.059	▲ 0.010	▲ 0.048				-	▲ 0.114							
3W			0.001				-	▲ 0.118							
1M			0.350				-	▲ 0.125							
3M							▲ 0.118	▲ 0.123							
6M							▲ 0.162	▲ 0.130							
1Y							▲ 0.120	▲ 0.100							
										日付	8/4	8/7	8/8	8/9	8/10
										日銀当預残	5,350,600	5,359,500	5,360,500	5,351,500	5,383,600
										準備預金残	4,663,700	4,676,900	4,657,700	4,645,400	4,694,900
										マネタリーベース	6,610,800	6,619,300	6,620,600	6,612,000	6,644,800
										無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.075%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.072%
										コール市場残高	177,207	167,673	174,413	181,750	170,836
										うち無担	146,775	136,399	143,460	150,699	139,904
										うちO/N	77,642	67,946	74,407	82,346	69,601
										うち有担	30,432	31,274	30,953	31,051	30,932

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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		2023/8/15		0.415	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		2023/8/15		0.620	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/14	2023/8/15	▲0.350	38,005	38,005		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/14	2023/8/15	▲0.350	432	432		▲0.350	▲0.350	

*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。

●2023年8月15日の予定

*4-6月期のGDP 1次速報 (市場予想:前年比年率+3.1%)	*7月の米小売売上高 *6月の米企業在庫	*5年利付国債入札 (25,000億円、8/16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