

# Central Daily Market Report

2023年8月21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21日 需給速報	2023年8月22日 需給予想	2023年8月23日 当社予想			
銀行券	400	100	▲ 200			
財政	5,000	▲ 6,900	▲ 5,000			
資金過不足	5,400	▲ 6,800	▲ 5,200			
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		▲ 100		▲ 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			1,000			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 32,800	31,700		32,800		
当預増減	4,200	26,700	▲ 5,200			
当座預金残高	5,445,600	5,472,300	5,467,100			
準備預金残高	4,747,900					
積み終了先	4,744,100			8月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,743,000			積数	29,800	
非準備預金先	697,700			1日平均	1,200	
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	99.26%	日数	19.35%		

## ●2023年8月21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▲0.073~▲0.065%近辺での出会いとなった。前週に引き続きオファーサイドの運用ニーズが強い状況の中、出会いレートの水準は前営業日比で概ね横這い圏での推移となった。ターム物はショートターム物で出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13~▲0.12%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>

21日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は、入札件数が少なく閑散としていた。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

2023/8/21	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	前日比	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	▲ 0.065					-	▲ 0.106	0.650	0.025	31,565.64	114.88	145.32-33	145.45-47
T/N								-	▲ 0.121						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.060					-	▲ 0.118						
2W	▲ 0.070	▲ 0.065	▲ 0.068					-	▲ 0.121						
3W								-	▲ 0.123						
1M								-	▲ 0.129						
3M			0.028					▲ 0.125	▲ 0.126						
6M								▲ 0.142	▲ 0.122						
1Y								▲ 0.079	▲ 0.091						
										日付	8/14	8/15	8/16	8/17	8/18
										日銀当預残	5,379,000	5,457,700	5,435,700	5,454,900	5,441,400
										準備預金残	4,722,600	4,781,500	4,742,900	4,758,100	4,745,100
										マネタリーベース	6,639,800	6,718,300	6,695,900	6,714,900	6,701,000
										無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.029%	▲0.060%	▲0.064%	▲0.064%
										コール市場残高	180,311	162,722	158,126	170,911	183,606
										うち無担	149,977	134,076	128,932	141,888	155,644
										うちO/N	81,824	68,658	63,714	70,565	78,351
										うち有担	30,334	28,646	29,194	29,023	27,962

## ●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	棄分率	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		2023/8/22		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		2023/8/22		0.586	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/8/21	2023/8/22	▲0.350	33,239	33,239		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/8/21	2023/8/22	▲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22日の予定

*7月の米中古住宅販売	*流動性供給入札(5,000億円、8/23発行)	*交付税特別会計借入(12,000億円、8/31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