

Central Daily Market Report

2023年9月21日(木)

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9月21日 需給速報	2023年9月22日 需給予想	2023年9月25日 当社予想			
銀行券	▲ 400	0	1,500			
財政	▲ 2,500	▲ 5,900	20,000			
資金過不足	▲ 2,900	▲ 5,900	21,500			
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	1,000					
国債買入	17,600					
CP等買入		▲ 200		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 債権等買入	1,000	▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 36,600	39,300		36,600		
当預増減	19,100	30,000		21,500		
当座預金残高	5,491,000	5,521,000		5,542,500		
準備預金残高	4,783,900					
積み終了先	4,780,000			9月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,778,100			積数	37,400	
非準備預金先	707,100			1日平均	1,600	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,882,600	
準備預金進捗率	実績	99.04%		日数	20.00%	

●2023年9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▲0.075~▲0.035%近辺での出会いとなった。
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、▲0.20~▲0.15%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日はTB3M物(第1184回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。
また、マーケットでは1Y物に出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は一部の業態で大型発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/9/21	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	売買参考統計値	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	▲ 0.049					-	▲ 0.162	0.745	0.025	32,571.03	▲ 452.75	148.31-33	148.24-26
T/N								-	▲ 0.181						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.024					-	▲ 0.188						
2W								-	▲ 0.209						
3W								-	▲ 0.180						
1M								-	▲ 0.173						
3M	0.028	0.029	0.028					▲ 0.172	▲ 0.143						
6M								▲ 0.155	▲ 0.127						
1Y								▲ 0.054	▲ 0.081						
日付		9/13	9/14	9/15	9/19	9/20									
日銀当預残	5,394,500	5,413,000	5,435,300	5,439,400	5,471,900										
準備預金残	4,778,900	4,784,500	4,748,100	4,740,900	4,775,000										
マネタリーベース	6,649,400	6,668,200	6,690,200	6,693,800	6,725,900										
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.012%	▲0.043%	▲0.059%	▲0.056%										
コール市場残高	171,645	165,728	177,470	202,699	201,647										
うち無担	141,859	137,037	147,631	173,435	173,732										
うちO/N	69,401	66,919	78,403	100,727	94,754										
うち有担	29,786	28,691	29,839	29,264	27,915										

●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	1184	-	56,000	2023/9/25	2023/12/25	147,252.1	45,262.5	100.0345	▲0.1383%	7.0531%	100.0376	▲0.1507%	10,737.0
流動性供給	390	-	5,000	2023/9/22	-	16,396.0	4,990.00	-	0.0130%	29.5454%	-	0.0090%	-

●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		2023/9/22		0.280	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		2023/9/22		0.505	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/21	2023/9/22	▲0.450	37,188	37,188		▲0.450	▲0.451	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/21	2023/9/22	▲0.450	0	0				

*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361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9月22日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*8月の全国消費者物価指数(GPI)
*植田日銀総裁定例会見	(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.0%)

◆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論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