

Central Daily Market Report

2023年9月25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9月25日 需給速報	2023年9月26日 需給予想	2023年9月27日 当社予想			
銀行券	600	▲ 100	▲ 1,000			
財政	11,400	4,200	▲ 22,000			
資金過不足	12,000	4,100	▲ 23,000			
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						▲ 9,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 36,500	37,400		36,500		
当預増減	12,500	40,200		▲ 32,400		
当座預金残高	5,494,100	5,534,300		5,501,900		
準備預金残高	4,807,400					
積み終了先	4,805,200			9月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,805,100			積数	26,000	
非準備預金先	686,700			1日平均	1,300	
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	99.33%		日数	33.33%	

●2023年9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▲0.08~▲0.02%近辺での出会いとなった。前営業日比では、横ばいから若干低下で推移した。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、▲0.22~▲0.18%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日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2023/9/25	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	▲ 0.042				-	▲ 0.130	0.725	▲ 0.016	32,678.62	276.21	148.43-45	148.43-45
T/N							-	▲ 0.181						
S/N							-	-						
1W	0.002	0.070	0.032				-	▲ 0.275						
2W	▲ 0.040	0.020	▲ 0.036				-	▲ 0.234						
3W							-	▲ 0.215						
1M			0.100				-	▲ 0.199						
3M							▲ 0.185	▲ 0.149						
6M							▲ 0.155	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.064	▲ 0.082						
日付	9/15	9/19	9/20	9/21	9/22									
日銀当預残	5,435,300	5,439,400	5,471,900	5,491,000	5,481,600									
準備預金残	4,748,100	4,740,900	4,775,000	4,783,900	4,796,300									
マネタリーベース	6,690,200	6,693,800	6,725,900	6,745,400	6,736,000									
無担O/N加重平均	▲ 0.043%	▲ 0.059%	▲ 0.056%	▲ 0.049%	▲ 0.039%									
コール市場残高	177,470	202,699	201,647	209,937	214,493									
うち無担	147,631	173,435	173,732	182,306	188,552									
うちO/N	78,403	100,727	94,754	99,483	104,799									
うち有担	29,839	29,264	27,915	27,631	25,941									

●入札結果

名称	回数	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		2023/9/26		0.259	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		2023/9/26		0.480	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/25	2023/9/26	▲ 0.550	37,154	37,154		▲ 0.550	▲ 0.551	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/25	2023/9/26	▲ 0.550	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26日の予定

*月例経済報告	*7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(7,000億円、9/27発行)
*8月の企業向けサービス価格指数	*8月の米新築一戸建て販売件数	
	*9月の米CB消費者信頼感指数	

◆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