

Central Daily Market Report

2023年9月26日(火)

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26日 需給速報 | 2023年9月27日 需給予想 | 2023年9月28日 当社予想 | | | |
|------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|-----------------|-----------|-----|
| 銀行券 | ▲ 200 | 200 | ▲ 1,000 | | | |
| 財政 | 3,900 | ▲ 17,600 | ▲ 3,000 | | | |
| 資金過不足 | 3,700 | ▲ 17,400 | ▲ 4,000 | | | |
| 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 | | 8,500 | ▲ 9,400 | | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | 1,000 | | | | |
| 国債買入 | | | | | | |
| CP等買入 | | ▲ 400 | ▲ 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 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 27,400 | 36,500 | 27,400 | | | |
| 当増減 | 12,400 | 9,800 | ▲ 4,000 | | | |
| 当座預金残高 | 5,506,500 | 5,516,300 | 5,512,300 | | | |
| 準備預金残高 | 4,800,900 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,798,800 | | | 9月27日以降の残り所要積立額 | | |
| 超過準備 | 4,798,800 | | | 積数 | 23,900 | |
| 非準備預金先 | 705,600 | | | 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 | 99.38% | 日数 | 36.67% | | |

●2023年9月26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▲0.085~▲0.025%近辺での出会いとなった。オファーサイドの資金運用ニーズの高まりを受け、ビッドサイドでは、先行きのレート低下を警戒し、慎重な姿勢をとった先が多くなったため、全体的にレートが低下する展開となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.30~▲0.20%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>

26日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、強めの結果となった。また、マーケットでは1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分落札レート0.000%、平均落札レート+0.016%と前回比(按分落札レート▲0.003%・平均落札レート+0.008%)で按分・平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

| 2023/9/26 | 無担(速報) | | | 有担(速報) | | | 短国 売買参考統計値 | 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) |
| O/N | ▲ 0.087 | 0.001 | ▲ 0.051 | | | | - | ▲ 0.185 | 0.740 | 0.015 | 32,315.05 | ▲ 363.57 | 148.80-82 | 148.86-88 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.251 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | 0.003 | 0.130 | 0.042 | | | | - | ▲ 0.326 | | | | | | |
| 2W | | | | | | | - | ▲ 0.252 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.224 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.203 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.195 | ▲ 0.152 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.155 | ▲ 0.120 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.070 | ▲ 0.081 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 9/19 | 9/20 | 9/21 | 9/22 | 9/25 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 5,439,400 | 5,471,900 | 5,491,000 | 5,481,600 | 5,494,100 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 4,740,900 | 4,775,000 | 4,783,900 | 4,796,300 | 4,807,000 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 6,693,800 | 6,725,900 | 6,745,400 | 6,736,000 | 6,747,900 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.059% | ▲0.056% | ▲0.049% | ▲0.039% | ▲0.042% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 202,699 | 201,647 | 209,937 | 214,493 | 208,249 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 173,435 | 173,732 | 182,306 | 188,552 | 180,404 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 100,727 | 94,754 | 99,483 | 104,799 | 100,201 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 29,264 | 27,915 | 27,631 | 25,941 | 27,845 |

●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) |
|---------|----|--------|-------|-----------|-----------|---------|---------|-------|-------------|----------|--------|-------------|---------------|
| 40年利付国債 | 16 | 1.300% | 7,000 | 2023/9/27 | 2063/3/20 | 20,638 | 6,996 | 87.87 | 1.725% | 55.8514% | | | |

●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 |
|-------------------------------|----------------|-----------|------------|--------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国庫短期証券買入 | 1,000 | 2023/9/27 | | | 4,781 | 1,000 | 0.000 | | 0.000 | 88.8 |
| 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1 | | 2023/9/27 | | 0.275 | 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 | | 2023/9/27 | | 0.495 | 0 | 0 | | | | |
| 米ドル資金供給 | | 2023/9/28 | 2023/10/5 | 5.580 | 0 | 0 | | | | |
| CP等買入 | 4,000 | 2023/9/29 | | | 6,779 | 3,994 | 0.000 | | 0.016 | 81.3 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2023/9/26 | 2023/9/27 | ▲0.450 | 27,820 | 27,820 | | ▲0.450 | ▲0.451 | |
| 共通担保資金供給(全店)<固定金利・金額無制限> | | 2023/9/27 | 2023/10/11 | 0.000 | 8,510 | 8,510 | | | | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2023/9/26 | 2023/9/27 | ▲0.450 | 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27日の予定

*金融政策決定会議事要旨(7月27、28日分)

*8月の米耐久財新規受注

*7月の景気動向指数改訂状況

◆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