

Central Daily Market Report

2023年9月27日(水)
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27日 需給速報	2023年9月28日 需給予想	2023年9月29日 当社予想			
銀行券	100	▲ 400	▲ 200			
財政	▲ 19,700	1,300	600			
資金過不足	▲ 19,600	900	400			
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		14,900				
CP等買入		▲ 300	▲ 1,300	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 28,100	27,400	28,100			
当増減	▲ 20,500	42,500	4,400			
当座預金残高	5,486,000	5,528,500	5,532,900			
準備預金残高	4,792,500					
積み終了先	4,790,900			9月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,790,900			積数	22,300	
非準備預金先	693,500			1日平均	1,200	
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	99.43%	日数	40.00%		

●2023年9月27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▲0.087~▲0.03%近辺での出会いとなった。ビッドサイドでは、引き続き先行きのレート低下を警戒し、慎重な姿勢をとる先が多く、ビッド優勢ななかギブン地合いとなった事で全体的にレートは低下した。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、▲0.45~▲0.25%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>

27日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施され、一部では大型発行も見られた。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

2023/9/27	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	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	▲ 0.064					-	▲ 0.259	0.735	▲ 0.005	32,371.90	56.85	149.03-05	149.02-04
T/N								-	▲ 0.397						
S/N			0.001					-	-						
1W	0.001	0.005	0.003					-	▲ 0.409						
2W								-	▲ 0.278						
3W								-	▲ 0.236						
1M			0.180					-	▲ 0.207						
3M			0.008					▲ 0.200	▲ 0.155						
6M								▲ 0.155	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.081	▲ 0.083						
										日付	9/20	9/21	9/22	9/25	9/26
										日銀当預残	5,471,900	5,491,000	5,481,600	5,494,100	5,506,500
										準備預金残	4,775,000	4,783,900	4,796,300	4,807,000	4,800,900
										マネタリーベース	6,725,900	6,745,400	6,736,000	6,747,900	6,760,400
										無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.049%	▲0.039%	▲0.042%	▲0.051%
										コール市場残高	201,647	209,937	214,493	208,249	226,934
										うち無担	173,732	182,306	188,552	180,404	205,074
										うちO/N	94,754	99,483	104,799	100,201	117,461
										うち有担	27,915	27,631	25,941	27,845	21,860

●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I非償債競争入札(億円)
今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		2023/9/28		0.260	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		2023/9/28		0.475	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/9/28			10,544	4,508	▲0.009		▲0.007	22.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/9/28			11,265	6,756	▲0.017		▲0.013	25.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/9/28			6,474	2,010	▲0.011		▲0.008	37.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/9/28			2,017	1,001	▲0.009		▲0.006	13.8
国債買入(物連動債)	600	2023/9/28			1,536	601	▲0.020		▲0.063	73.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/27	2023/9/28	▲0.550	28,557	28,557		▲0.550	▲0.555	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/27	2023/9/28	▲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28日の予定

*4-6月期の米GDP確報値	*2年利付国債入札(29,000億円、10/2発行)
----------------	----------------------------

- ◆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