

Central Daily Market Report

2023年9月28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28日 需給速報	2023年9月29日 需給予想	2023年10月2日 当社予想			
銀行券	▲ 400	100	1,000			
財政	0	▲ 3,600	▲ 2,300			
資金過不足	▲ 400	▲ 3,500	▲ 1,300			
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	14,900					
CP等買入	▲ 1,300	4,000	▲ 6,500			
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	▲ 33,500	28,100	33,500			
※以下は資金供給用担保需給速報						
当預増減	7,700	27,500	▲ 1,300			
当座預金残高	5,493,700	5,521,200	5,519,900			
準備預金残高	4,796,200					
積み終了先	4,794,800			9月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,794,300			積数	20,400	
非準備預金先	697,500			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	99.47%	日数	43.33%		

●2023年9月28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。例年、9月末日の調達を控える先が多く、今回は週末3日積みとなるため影響が大きく、そういった先からの前倒しでの調達が増加した事から、レートは小幅上昇する展開となった。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、▲1.00~▲0.50%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>

28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。

●短期金融市場関連指標

2023/9/28	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	▲ 0.063				-	▲ 0.259	0.755	0.020	31,872.52	▲ 499.38	149.49-51	149.31-32
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.547						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.362						
2W	▲ 0.057	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.263						
3W							-	▲ 0.221						
1M	▲ 0.022	0.040	▲ 0.014				-	▲ 0.197						
3M			0.030				▲ 0.230	▲ 0.155						
6M							▲ 0.155	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.083						
									日付	9/21	9/22	9/25	9/26	9/27
									日銀当預残	5,491,000	5,481,600	5,494,100	5,506,500	5,486,000
									準備預金残	4,783,900	4,796,300	4,807,000	4,800,900	4,788,000
									マネタリーベース	6,745,400	6,736,000	6,747,900	6,760,400	6,739,900
									無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.039%	▲0.042%	▲0.051%	▲0.064%
									コール市場残高	209,937	214,493	208,249	226,934	226,543
									うち無担	182,306	188,552	180,404	205,074	203,706
									うちO/N	99,483	104,799	100,201	117,461	112,213
									うち有担	27,631	25,941	27,845	21,860	22,837

●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)	募入最低値	募入最高利回/利回較差	棄分率	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)
2年利付国債	453	0.005%	29,000	2023/10/2	2025/10/1	77,358	23,632	99.910	0.050%	24.3261%	99.920	0.045%	5,361

●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		2023/9/29		0.265	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		2023/9/29		0.475	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフアー分)		2023/9/28	2023/9/29	▲0.650	34,050	34,050		▲0.650	▲0.651	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフアー分)		2023/9/28	2023/9/29	▲0.650	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29日の予定

*9月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.6%)	*8月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1185回)
*8月の有効求人倍率(市場予想:1.29倍)	*9月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、56,000億円、10/2発行)
*8月の完全失業率(市場予想:2.6%)	*9月のユーロ圏消費者物価指数速報	*交付税特別会計借入
*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲0.8%)	値	(13,000億円、10/11借入)
*8月の商業動態統計速報	*8月の住宅着工統計	
	*9月の消費動向調査	
	*4-6月期の英GDP確報値	

◆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ようお願ひ申し上げます。

◆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場合があります。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