

Central Daily Market Report

2023年10月2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10月2日 需給速報	2023年10月3日 需給予想	2023年10月4日 当社予想			
銀行券	400	200	500			
財政	▲ 28,000	▲ 14,000	▲ 63,000			
資金過不足	▲ 27,600	▲ 13,800	▲ 62,500			
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						
国債買入	3,000					
CP等買入		▲ 200				
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	▲ 40,400	48,400	40,400			
当預増減	▲ 16,800	26,600	▲ 62,500			
当座預金残高	5,455,200	5,481,800	5,419,300			
準備預金残高	4,759,800					
積み終了先	4,759,100			10月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,759,100			積数	3,600	
非準備預金先	695,400			1日平均	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	99.91%	日数	56.67%		

●2023年10月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.087~▲0.035%近辺の出合いが始まった。四半期末要因剥落により、調達を再開する先が散見された一方で、運用サイドの一部は引き続き様子見となったことで、レートは上昇した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.155~▲0.11%程度での出合いとなった。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>

2日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、入札件数が少なく閑散であった。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

2023/10/2	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	▲ 0.044				-	▲ 0.122	0.770	0.005	31,759.88	▲ 97.74	149.52-54	149.74-76
T/N								-	▲ 0.131						
S/N								-	-						
1W		▲ 0.060	▲ 0.013	▲ 0.050				-	▲ 0.148						
2W		▲ 0.058	0.030	▲ 0.038				-	▲ 0.154						
3W				▲ 0.045				-	▲ 0.160						
1M		▲ 0.045	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.163						
3M				0.030				▲ 0.308	▲ 0.194						
6M								▲ 0.155	▲ 0.125						
1Y								▲ 0.095	▲ 0.085						
										日付	9/25	9/26	9/27	9/28	9/29
										日銀当預残	5,494,100	5,506,500	5,486,000	5,493,700	5,472,000
										準備預金残	4,807,000	4,800,900	4,788,000	4,796,300	4,799,300
										マネタリーベース	6,747,900	6,760,400	6,739,900	6,747,900	6,726,100
										無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.051%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%
										コール市場残高	208,249	226,934	226,543	237,690	142,574
										うち無担	180,404	205,074	203,706	215,795	122,880
										うちO/N	100,201	117,461	112,213	125,522	77,037
										うち有担	27,845	21,860	22,837	21,895	19,694

●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		2023/10/3		0.235	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		2023/10/3		0.440	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/2	2023/10/3	▲0.350	41,126	41,126		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/2	2023/10/3	▲0.350	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10月3日の予定

*9月のマネタリーベース	*10年利付国債入札(27,000億円、10/4発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	

◆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