

Central Daily Market Report

2023年10月4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10月4日 需給速報	2023年10月5日 需給予想	2023年10月6日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 200	▲ 500			
財政	▲ 64,600	100	▲ 8,000			
資金過不足	▲ 64,700	▲ 100	▲ 8,500			
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	1,000					
国債買入		18,900				
CP等買入		▲ 100	▲ 100			
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	▲ 43,600	38,000	43,600			
当預増減	▲ 69,400	62,300	▲ 8,500			
当座預金残高	5,372,200	5,434,500	5,426,000			
準備預金残高	4,692,900					
積み終了先	4,692,200			10月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,692,200			積数	1,900	
非準備預金先	679,300			1日平均	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	99.95%	日数	63.33%		

●2023年10月4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▲0.065~▲0.008%近辺の出合いが始まった。引き続き、ビッドサイドの資金調達ニーズは強く、取引開始直後から取り上がる動きが散見された。一巡後も朝夕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散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲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>

4日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、一部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

2023/10/4	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	▲ 0.021					-	▲ 0.103	0.805	0.045	30,526.88	▲ 711.06	149.17-18	148.84-85
T/N								-	▲ 0.131						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.018	0.005	▲ 0.012					-	▲ 0.156						
2W	▲ 0.025	▲ 0.005	▲ 0.020					-	▲ 0.162						
3W								-	▲ 0.170						
1M			0.001					-	▲ 0.180						
3M								▲ 0.305	▲ 0.201						
6M								▲ 0.155	▲ 0.126						
1Y								▲ 0.095	▲ 0.087						
日付		9/27	9/28	9/29	10/2	10/3									
日銀当預残		5,486,000	5,493,700	5,472,000	5,455,200	5,441,600									
準備預金残		4,788,000	4,796,300	4,799,300	4,760,000	4,732,000									
マネタリーベース		6,739,900	6,747,900	6,726,100	6,708,900	6,695,200									
無担O/N加重平均		▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.044%	▲0.031%									
コール市場残高		226,543	237,690	142,574	185,184	203,125									
うち無担		203,706	215,795	122,880	158,378	175,480									
うちO/N		112,213	125,522	77,037	93,240	104,632									
うち有担		22,837	21,895	19,694	26,806	27,645									

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2023/10/16	2024/4/15	462,875	12,990.39		0.000%	2.8065%		0.000%		10

●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		2023/10/5		0.240	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		2023/10/5		0.445	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/10/5			2,161	1,501	▲0.028		0.009	60.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/10/5			13,478	4,253	0.008		0.011	18.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/10/5			7,116	4,501	0.009		0.015	87.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/10/5			18,181	6,756	0.021		0.023	48.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/10/5			7,790	2,006	0.036		0.038	79.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/4	2023/10/5	▲0.450	44,406	44,406		▲0.450	▲0.453	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/4	2023/10/5	▲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372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5日の予定

*8月の米貿易収支	*国庫短期証券(1186回)入札 (6ヶ月、40,000億円、10/6発行)	*30年利付国債入札 (9,000億円、10/6発行)
-----------	---	--------------------------------

◆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よう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