

Central Daily Market Report

2023年10月5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10月5日 需給速報	2023年10月6日 需給予想	2023年10月10日 当社予想			
銀行券	▲ 200	0	800			
財政	▲ 700	▲ 10,900	5,000			
資金過不足	▲ 900	▲ 10,900	5,800			
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	18,900					
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
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						
国債補充供給	▲ 41,900	43,600		41,900		
当預増減	19,600	30,400		5,800		
当座預金残高	5,391,800	5,422,200		5,428,000		
準備預金残高	4,708,700					
積み終了先	4,708,500			10月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,707,900			積数	1,100	
非準備預金先	683,100			1日平均	100	
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	99.97%		日数	66.67%	

●2023年10月5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▲0.05~▲0.005%近辺の出会いが始まった。引き続き、旺盛な資金調達ニーズを受けて、出会いの水準は前日比で上昇した。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.03~▲0.015%近辺の出会いが見られ、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、▲0.125~▲0.100%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＞

5日はTB6M物(第1186回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2023/10/5	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	▲ 0.015				-	▲ 0.101	0.800	▲ 0.005	31,075.36	548.48	148.98-99	149.04-07
T/N				▲ 0.020				-	▲ 0.119						
S/N								-	-						
1W		▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.150						
2W				▲ 0.015				-	▲ 0.161						
3W								-	▲ 0.166						
1M				0.250				-	▲ 0.178						
3M								▲ 0.305	▲ 0.200						
6M								▲ 0.167	▲ 0.126						
1Y								▲ 0.095	▲ 0.087						
										日付	9/28	9/29	10/2	10/3	10/4
										日銀当預残	5,493,700	5,472,000	5,455,200	5,441,600	5,372,200
										準備預金残	4,796,300	4,799,300	4,760,000	4,732,000	4,693,000
										マネタリーベース	6,747,900	6,726,100	6,708,900	6,695,200	6,625,800
										無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.062%	▲0.044%	▲0.031%	▲0.021%
										コール市場残高	237,690	142,574	185,184	203,125	212,513
										うち無担	215,795	122,880	158,378	175,480	185,815
										うちO/N	125,522	77,037	93,240	104,632	114,212
										うち有担	21,895	19,694	26,806	27,645	26,698

●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	乗分率	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)
国庫短期証券	1186	-	40,000	2023/10/10	2024/4/10	122,497	33,686.5	100.075	▲0.1494%	40.6837%	100.084	▲0.1674%	6,313
30年利付国債	80	1.8%	9,000	2023/10/6	2053/9/20	22,346	7,306	101.65	1.716%	82.5531%	102.15	1.691%	1,693

●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		2023/10/6		0.195	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		2023/10/6		0.390	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/5	2023/10/6	▲0.350	42,844	42,844		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/5	2023/10/6	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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6日の予定

*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*9月の米雇用統計	*国庫短期証券(1187回)入札
*8月の毎月勤労統計調査速報	*8月の米消費者信用残高	(3ヶ月、56,000億円、10/10発行)
*8月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲4.3%)		
*8月の景気動向指数速報		

◆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