

Central Daily Market Report

2023年10月19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19日 需給速報	2023年10月20日 需給予想	2023年10月23日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 100	▲ 500			
財政	8,600	▲ 7,300	3,000			
資金過不足	7,700	▲ 7,400	2,500			
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	3,900					
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100		▲ 1,600		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 37,800	35,300		37,800		
※以下の資金需給は総務課提供情報						
当預増減	8,700	28,600		2,500		
当座預金残高	5,475,100	5,503,700		5,506,200		
準備預金残高	4,790,000					
積み終了先	4,781,800			10月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,776,100			積数	41,700	
非準備預金先	685,100			1日平均	1,500	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					4,006,500	
準備預金進捗率	実績	98.96%		日数	12.90%	

●2023年10月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担ON物は、国内勢を中心に▲0.010~▲0.005%近辺の出合いが始まった。引き続き積極的な調達が見られ、レート水準は高止まりした。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで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▲0.020~▲0.010%近辺で散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%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>

19日はTB1Y物(第1189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、堅調に推移した。この他、3M物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2023/10/19	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.010					-	▲ 0.096	0.840	0.035	31,430.62	▲ 611.63	149.76-78	149.80-81
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	0.030	▲ 0.022					-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.036					-	▲ 0.157						
3W								-	▲ 0.166						
1M	▲ 0.005	0.011	0.008					-	▲ 0.174						
3M								▲ 0.215	▲ 0.197						
6M								▲ 0.171	▲ 0.127						
1Y								▲ 0.050	▲ 0.087						
日付		10/12	10/13	10/16	10/17	10/18									
日銀当預残	5,372,200	5,454,700	5,456,100	5,478,300	5,466,400										
準備預金残	4,698,100	4,751,000	4,755,100	4,768,400	4,762,200										
マネタリーベース	6,626,300	6,708,300	6,708,900	6,731,000	6,719,400										
無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.019%	▲0.028%	▲0.015%	▲0.011%										
コール市場残高	206,275	193,131	178,461	187,425	188,563										
うち無担	177,901	165,524	150,018	159,159	160,274										
うちO/N	104,953	95,876	84,185	94,561	93,027										
うち有担	28,374	27,607	28,443	28,266	28,289										

●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	素分率	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	1189	-	35,000	2023/10/20	2024/10/21	109,899	28,901.7	100.021	▲0.0208%	53.6065%	100.031	▲0.0308%	6,098
流動性供給	391	-	5,000	2023/10/20	-	17,858	4,983		0.023%	32.6516%		0.020%	

●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		2023/10/20		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		2023/10/20		0.435	0	0				
社債等買入	1,000	2023/10/24			2,607	1,001	0.358		0.369	33.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/19	2023/10/20	▲0.350	38,485	38,485		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/19	2023/10/20	▲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20日の予定

*全国信用組合大会にて植田日銀総裁講演	*国庫短期証券(1190回)入札
*9月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.7%)	(3ヶ月、56,000億円、10/23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