

Central Daily Market Report

2023年10月20日(金)

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20日 需給速報	2023年10月23日 需給予想	2023年10月24日 当社予想			
銀行券	▲ 100	100	▲ 1,000			
財政	▲ 6,700	8,700	2,000			
資金過不足	▲ 6,800	8,800	1,000			
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						
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 1,600			1,000	
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 34,100	37,800		34,100		
当預増減	▲ 4,900	42,600		2,000		
当座預金残高	5,470,200	5,512,800		5,514,800		
準備預金残高	4,791,200					
積み終了先	4,786,900			10月23日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,785,800			積数	25,600	
非準備預金先	679,000			1日平均	1,100	
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	99.36%		日数	22.58%	

●2023年10月20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%近辺の出会いが始まった。週末3日積みとなったことで、引き続き積極的な調達が見られたものの、出会い水準は前日比で概ね横ばい圏での推移となり、レートの上昇に一服感が見られた。一巡後は出し手の調整による散発的な出会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、▲0.095~▲0.09%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>

20日はTB3M物(第1190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。

<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

2023/10/20	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	
	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)
単位：%									0.835	▲ 0.005	31,259.36	▲ 171.26	149.78-81	149.97-98
O/N	▲ 0.085	▲ 0.003	▲ 0.010				-	▲ 0.094						
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.013	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.131						
2W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.152						
3W							-	▲ 0.160						
1M							-	▲ 0.168						
3M							▲ 0.200	▲ 0.196						
6M							▲ 0.171	▲ 0.125						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.087						
日付		10/13	10/16	10/17	10/18	10/19								
日銀当預残	5,454,700	5,456,100	5,478,300	5,466,400	5,475,100									
準備預金残	4,751,000	4,755,100	4,768,400	4,762,200	4,790,000									
マネタリーベース	6,708,300	6,708,900	6,731,000	6,719,400	6,729,100									
無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.028%	▲ 0.015%	▲ 0.011%	▲ 0.010%									
コール市場残高	193,131	178,461	187,425	188,563	177,162									
うち無担	165,524	150,018	159,159	160,274	149,632									
うちO/N	95,876	84,185	94,561	93,027	81,185									
うち有担	27,607	28,443	28,266	28,289	27,530									

●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	1190	-	56,000	2023/10/23	2024/1/29	136,400	45,390.4	100,049.0	▲0.1824%	66.5160%	100.0518	▲0.1928%	10,609

●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		2023/10/23		0.160	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		2023/10/23		0.395	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/20	2023/10/23	▲0.350	34,765	34,765		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/20	2023/10/23	▲0.350	50	50		▲0.350	▲0.350	

*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23日の予定

*特にありません

◆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ようお願いします。

◆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