

Central Daily Market Report

2023年10月24日(火)

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24日 需給速報	2023年10月25日 需給予想	2023年10月26日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 100	▲ 1,000			
財政	600	5,300	▲ 5,000			
資金過不足	300	5,200	▲ 6,000			
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			17,100	▲ 6,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	17,600		3,900			
CP等買入		▲ 400		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000			▲ 600		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 34,700	33,200		34,700		
※下り資金供給用担保確保債						
当増減	17,000		54,400		▲ 6,000	
当座預金残高	5,498,300		5,552,700		5,546,700	
準備預金残高	4,813,100					
積み終了先	4,810,600				10月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,810,600				積数	20,100
非準備預金先	685,200				1日平均	900
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	99.50%			日数	29.03%

●2023年10月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.015~▲0.009%程度での出合いが始まった。ビッドサイドの一部に調達ニーズの低下が見られた事で、全体のレート目線もやや低下した。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散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.095%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>

24日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱い結果となった。マーケットで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

2023/10/24	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	▲ 0.014					-	▲ 0.099	0.840	▲ 0.020	31,062.35	62.80	149.77-78	149.47-49
T/N								-	▲ 0.099						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.028	▲ 0.003	▲ 0.020					-	▲ 0.136						
2W			▲ 0.025					-	▲ 0.152						
3W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.161						
1M								-	▲ 0.169						
3M			0.030					▲ 0.203	▲ 0.192						
6M								▲ 0.171	▲ 0.115						
1Y								▲ 0.054	▲ 0.081						
日付		10/17	10/18	10/19	10/20	10/23									
日銀当預残		5,478,300	5,466,400	5,475,100	5,470,200	5,481,300									
準備預金残		4,768,400	4,762,200	4,790,000	4,791,300	4,791,400									
マネタリーベース		6,731,000	6,719,400	6,729,100	6,724,300	6,735,300									
無担O/N加重平均		▲0.015%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.012%									
コール市場残高		187,425	188,563	177,162	177,856	179,757									
うち無担		159,159	160,274	149,632	150,250	152,074									
うちO/N		94,561	93,027	81,185	81,703	82,187									
うち有担		28,266	28,289	27,530	27,606	27,683									

●入札結果

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
国庫短期証券買入	1,000	2023/10/25			5,710	1,003	0.020		0.020	81.1
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/10/25		0.140	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		2023/10/25		0.380	0	0				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/10/25			8,639	3,001	▲0.012		▲0.010	40.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2023/10/25			2,605	1,005	▲0.009		▲0.006	5.7
米ドル資金供給		2023/10/26	2023/11/2	5.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/24	2023/10/25	▲0.350	35,441	35,441		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)<固定金利・金額無制限>		2023/10/25	2023/11/8	0.000	7,061	7,061				
共通担保資金供給(全店)<金利入札方式>	10,000	2023/10/25	2028/10/25		35,130	10,003	0.320		0.338	27.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/24	2023/10/25	▲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25日の予定

*9月の米新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札 (5,000億円、10/26発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、11/2借入)
-----------------	-------------------------------	---------------------------------

◆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ず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