

Central Daily Market Report

2023年10月25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25日 需給速報	2023年10月26日 需給予想	2023年10月27日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 1,200	▲ 800			
財政	5,300	▲ 200	1,000			
資金過不足	5,200	▲ 1,400	200			
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	3,900					
CP等買入		▲ 500	▲ 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		▲ 600	▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 36,300	34,700	36,300			
当預増減	18,100	34,500	200			
当座預金残高	5,516,400	5,550,900	5,551,100			
準備預金残高	4,809,200					
積み終了先	4,806,700			10月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,806,700			積数	17,600	
非準備預金先	707,200			1日平均	800	
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	99.56%	日数	32.26%		

●2023年10月25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▲0.02~▲0.015%近辺での出合いが始まった。前日からの流れを受け、ビッドサイドのレート水準は低下傾向となった。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、▲0.11~▲0.10%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>

25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発行市場は複数の業態で発行が観測され、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

2023/10/25	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	▲ 0.018					-	▲ 0.097	0.850	0.010	31,269.92	207.57	149.85-86	149.90-91
T/N								-	▲ 0.101						
S/N			▲ 0.025					-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.018	▲ 0.026					-	▲ 0.141						
2W			▲ 0.020					-	▲ 0.157						
3W								-	▲ 0.163						
1M	▲ 0.003	0.003	▲ 0.002					-	▲ 0.169						
3M								▲ 0.203	▲ 0.191						
6M								▲ 0.171	▲ 0.113						
1Y								▲ 0.054	▲ 0.081						
										日付	10/18	10/19	10/20	10/23	10/24
										日銀当預残	5,466,400	5,475,100	5,470,200	5,481,300	5,498,300
										準備預金残	4,762,200	4,790,000	4,791,300	4,791,400	4,813,100
										マネタリーベース	6,719,400	6,729,100	6,724,300	6,735,300	6,752,600
										無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.012%	▲0.014%
										コール市場残高	188,563	177,162	177,856	179,757	178,569
										うち無担	160,274	149,632	150,250	152,074	151,121
										うちO/N	93,027	81,185	81,703	82,187	81,634
										うち有担	28,289	27,530	27,606	27,683	27,448

●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非償還入札(億円)	非償還入札(億円)
流動性供給	392	-	5,000	2023/10/26	-	13,857	4,984		0.032%	67.9093%		0.029%		
交付税特会	-	-	13,000	2023/11/2	2024/5/2	473,572	12,990.01		0.000%	2.7430%		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		2023/10/26		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		2023/10/26		0.410	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/25	2023/10/26	▲0.350	37,018	37,018		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/25	2023/10/26	▲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26日の予定

*9月の企業向けサービス価格指数	*ECB理事会	*7-9月期の米GDP速報値	*9月の米耐久財新規受注
------------------	---------	----------------	--------------

◆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