

# Central Daily Market Report

2023年10月26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26日 需給速報	2023年10月27日 需給予想	2023年10月30日 当社予想			
銀行券	▲ 1,300	▲ 400	500			
財政	▲ 200	1,100	2,600			
資金過不足	▲ 1,500	700	3,100			
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		▲ 300		▲ 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		▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 38,200	36,300		38,200		
当預増減	▲ 3,800	38,600		3,100		
当座預金残高	5,512,600	5,551,200		5,554,300		
準備預金残高	4,818,600					
積み終了先	4,816,100			10月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,816,100			積数	15,100	
非準備預金先	694,000			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	99.62%		日数	35.48%	

## ●2023年10月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.02~▲0.015%近辺での調達で始まった。調達ニーズ減退によるレート低下の動きには一服感が見られた事から、前日と同水準での推移となった。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物での引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13~▲0.105%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>

26日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.000%、平均落札レート+0.023%と、前回比(按分0.000%・平均+0.011%)で按分は横這い、平均は上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/10/26	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)
O/N	▲ 0.087	▲ 0.005	▲ 0.019				-	▲ 0.099	0.880	0.030	30,601.78	▲ 668.14	150.09-11	150.46-48
T/N							-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.028				-	▲ 0.146						
2W	▲ 0.020	0.030	▲ 0.001				-	▲ 0.157						
3W							-	▲ 0.161						
1M							-	▲ 0.168						
3M							▲ 0.203	▲ 0.191						
6M							▲ 0.171	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.054	▲ 0.081						
日付	10/19	10/20	10/23	10/24	10/25									
日銀当預残	5,475,100	5,470,200	5,481,300	5,498,300	5,516,400									
準備預金残	4,790,000	4,791,300	4,791,400	4,813,100	4,809,200									
マネタリーベース	6,729,100	6,724,300	6,735,300	6,752,600	6,770,800									
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.010%	▲0.012%	▲0.014%	▲0.018%									
コール市場残高	177,162	177,856	179,757	178,569	178,539									
うち無担	149,632	150,250	152,074	151,121	150,159									
うちO/N	81,185	81,703	82,187	81,634	78,452									
うち有担	27,530	27,606	27,683	27,448	28,380									

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/10/27		0.150	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		2023/10/27		0.405	0	0				
CP等買入	4,000	2023/10/31			7,355	4,000	0.000		0.023	83.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/26	2023/10/27	▲0.350	38,994	38,994		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/26	2023/10/27	▲0.350	20	20		▲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27日の予定

*10月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.5%)	*9月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1191回)入札 (3ヶ月、56,000億円、10/30発行)
---	---------------------	--

◆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