

Central Daily Market Report

2023年10月27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27日 需給速報	2023年10月30日 需給予想	2023年10月31日 当社予想			
銀行券	▲ 400	200	▲ 1,000			
財政	▲ 700	10,800	1,800			
資金過不足	▲ 1,100	11,000	800			
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		14,800				
CP等買入		▲ 300	▲ 400	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 45,400	38,200	45,400			
当増減	▲ 8,600	70,800	4,800			
当座預金残高	5,504,000	5,574,800	5,579,600			
準備預金残高	4,808,200					
積み終了先	4,806,900			10月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,806,800			積数	10,700	
非準備預金先	695,800			1日平均	600	
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	99.73%	日数	45.16%		

●2023年10月27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~▲0.01%近辺での出合いが始まった。週末3日積みとなったことで、ビッドサイドからの資金調達ニーズが強く、一部で取り上げる動きも見られたため、出合いの水準は前日対比で上昇する結果となった。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物での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13~▲0.11%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>

27日はTB3M物(第1191回)の入札が実施され、小じっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は月末発行にあたり、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/10/27	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	▲ 0.013				-	▲ 0.110	0.870	▲ 0.010	30,991.69	389.91	150.36-37	150.15-17
T/N							-	▲ 0.120						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.016				-	▲ 0.145						
2W							-	▲ 0.155						
3W			0.001				-	▲ 0.160						
1M			0.180				-	▲ 0.168						
3M	0.001	0.030	0.024				▲ 0.200	▲ 0.189						
6M							▲ 0.171	▲ 0.118						
1Y							▲ 0.054	▲ 0.084						
日付	10/20	10/23	10/24	10/25	10/26									
日銀当預残	5,470,200	5,481,300	5,498,300	5,516,400	5,512,600									
準備預金残	4,791,300	4,791,400	4,813,100	4,809,200	4,818,600									
マネタリーベース	6,724,300	6,735,300	6,752,600	6,770,800	6,768,300									
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.012%	▲0.014%	▲0.018%	▲0.019%									
コール市場残高	177,856	179,757	178,569	178,539	181,825									
うち無担	150,250	152,074	151,121	150,159	153,919									
うちO/N	81,703	82,187	81,634	78,452	82,212									
うち有担	27,606	27,683	27,448	28,380	27,906									

●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	1191	-	56,000	2023/10/30	2024/2/5	131,385.8	45,390.3	100.0485	▲0.1805%	68.1922%	100.0508	▲0.1891%	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		2023/10/30		0.120	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		2023/10/30		0.360	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/10/30			8,675	4,505	▲0.004		▲0.001	22.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/10/30			11,243	6,759	▲0.014		▲0.011	64.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/10/30			3,676	2,003	0.001		0.006	59.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/10/30			1,684	1,001	▲0.015		▲0.014	34.5
国債買入(物価連動債)	600	2023/10/30			1,344	602	▲0.010		▲0.056	84.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/27	2023/10/30	▲0.350	46,411	46,411		▲0.350	▲0.356	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/27	2023/10/30	▲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30日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、31日まで)	*2年利付国債入札(29,000億円、11/1発行)
*月例経済報告	

◆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