

Central Daily Market Report

2023年9月15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9月15日 需給速報	2023年9月19日 需給予想	2023年9月20日 当社予想			
銀行券	300	600	▲ 1,000			
財政	▲ 4,500	11,900	43,000			
資金過不足	▲ 4,200	12,500	42,000			
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	10,000					
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 700	▲ 300			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	35,400	▲ 16,800				
被災地支援						
社債等買入		▲ 900	▲ 1,200			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 27,000	26,500	27,000			
当預増減	22,300	38,000	42,000			
当座預金残高	5,435,300	5,473,300	5,515,300			
準備預金残高	4,748,100					
積み終了先	4,748,100			9月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,748,100			積数	63,800	
非準備預金先	687,200			1日平均	2,400	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,882,600	
準備預金進捗率	実績	98.36%	日数	10.00%		

●2023年9月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.050~▲0.040%近辺での出会いとなった。
ターム物はショートターム物での出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.11%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>

15日はTB3M物(第1182回)の入札が実施され、強めの結果となった。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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/9/15	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	売買参考統計値	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	▲ 0.043				-	▲ 0.114	0.705	0.000	33,533.09	364.99	147.45-47	147.75-77
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.121						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.127						
2W	▲ 0.062	0.000	▲ 0.054				-	▲ 0.153						
3W							-	▲ 0.153						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.155	▲ 0.135						
6M							▲ 0.152	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.084						
日付	9/8	9/11	9/12	9/13	9/14									
日銀当預残	5,391,400	5,414,400	5,415,200	5,394,500	5,413,000									
準備預金残	4,696,900	4,739,400	4,741,800	4,778,900	4,784,500									
マネタリーベース	6,648,200	6,670,200	6,670,200	6,649,400	6,668,200									
無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.060%	▲0.048%	▲0.016%	▲0.012%									
コール市場残高	171,907	177,992	177,534	171,645	165,728									
うち無担	140,845	148,998	147,578	141,859	137,037									
うちO/N	65,567	74,820	75,170	69,401	66,919									
うち有担	31,062	28,994	29,956	29,786	28,691									

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1182	-	56,000	2023/9/19	2023/12/18	146,706	45,262.2	100.0330	▲0.1337%	71.9459%	100.0347	▲0.1406%	10,737

●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		2023/9/19		0.295	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		2023/9/19		0.540	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/9/19		0.510	0	0				
社債等買入	1,000	2023/9/21			2,562	1,000	0.326		0.339	2.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/15	2023/9/19	▲0.350	27,423	27,423		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/15	2023/9/19	▲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371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360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。 ※3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9月18日の予定

*敬老の日

●2023年9月19日の予定

*米FOMC(1日目)

*8月の米住宅着工件数

*8月のユーロ圏消費者物価指数改定値

*国庫短期証券(1183回)入札
(1年、35,000億円、9/20発行)

*流動性供給入札
(5,000億円、9/20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