

Central Daily Market Report

2023年9月20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9月20日 需給速報	2023年9月21日 需給予想	2023年9月22日 当社予想			
銀行券	400	▲ 400	▲ 500			
財政	40,000	▲ 2,800	▲ 11,000			
資金過不足	40,400	▲ 3,200	▲ 11,500			
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		1,000				
国債買入		17,600				
CP等買入		▲ 100	▲ 200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 500	1,000	▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 39,300	32,000		39,300		
当預増減	32,500	55,400	▲ 11,500			
当座預金残高	5,471,900	5,527,300	5,515,800			
準備預金残高	4,775,000					
積み終了先	4,767,400			9月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,766,300			積数	43,100	
非準備預金先	696,900			1日平均	1,700	
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	98.89%	日数	16.67%		

●2023年9月20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▲0.08~▲0.045%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、▲0.18~▲0.13%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>

20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、やや強めな結果となった。また、マーケットでは1Y物に出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は一部の業態で大型発行が観測された。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

2023/9/20	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.056				-	▲ 0.128	0.720	0.005	33,023.78	▲ 218.81	147.74-77	148.13-15
T/N							-	▲ 0.174						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.059	▲ 0.020	▲ 0.052				-	▲ 0.179						
2W							-	▲ 0.198						
3W							-	▲ 0.178						
1M							-	▲ 0.170						
3M							▲ 0.155	▲ 0.140						
6M							▲ 0.155	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.044	▲ 0.081						
日付		9/12	9/13	9/14	9/15	9/19								
日銀当預残	5,415,200	5,394,500	5,413,000	5,435,300	5,439,400									
準備預金残	4,741,800	4,778,900	4,784,500	4,748,100	4,740,900									
マネタリーベース	6,670,200	6,649,400	6,668,200	6,690,200	6,693,800									
無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.043%	▲0.059%									
コール市場残高	177,534	171,645	165,728	177,470	202,699									
うち無担	147,578	141,859	137,037	147,631	173,435									
うちO/N	75,170	69,401	66,919	78,403	100,727									
うち有担	29,956	29,786	28,691	29,839	29,264									

●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	募入非価格競争入札(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
国庫短期証券買入	1,000	2023/9/21			6,139	1,001	0.000		0.006	74.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/9/21		0.285	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		2023/9/21		0.530	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		2023/9/21		0.500	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/9/21			6,709	4,251	▲0.013		▲0.008	84.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/9/21			12,404	4,506	0.001		0.004	58.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/9/21			16,221	6,756	0.000		0.003	0.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/9/21			5,481	2,005	0.006		0.009	21.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/20	2023/9/21	▲0.450	39,469	39,469		▲0.450	▲0.452	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/20	2023/9/21	▲0.450	320	320		▲0.450	▲0.450	

*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21日の予定

*日銀金融政策決定会合 (1日目、22日まで)	*英中銀MPC結果発表 *8月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1184回)入札(3ヶ月、56,000億円、9/25発行) *流動性供給入札(5,000億円、9/22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