

# Central Daily Market Report

2023年9月12日(火)  
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12日 需給速報	2023年9月13日 需給予想	2023年9月14日 当社予想			
銀行券	800	200	▲ 1,000			
財政	▲ 700	▲ 25,400	▲ 2,000			
資金過不足	100	▲ 25,200	▲ 3,000			
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			9,400	▲ 8,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 100		
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						
国債補完供給	▲ 26,300	27,400		26,300		
当預増減	800	6,600	▲ 3,000			
当座預金残高	5,415,200	5,421,800	5,418,800			
準備預金残高	4,741,800					
積み終了先	4,741,700			9月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,741,700			積数	200	
非準備預金先	673,400			1日平均	100	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					4,018,100	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.32%		

## ●2023年9月12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、▲0.095~▲0.085%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>

12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、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/9/12	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	▲ 0.048					-	▲ 0.096	0.705	0.000	32,776.37	308.61	146.67-69	146.80-82
T/N								-	▲ 0.095						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.040					-	▲ 0.117						
2W								-	▲ 0.122						
3W								-	▲ 0.150						
1M								-	▲ 0.156						
3M				0.025				▲ 0.145	▲ 0.136						
6M								▲ 0.150	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.086						
日付		9/5	9/6	9/7	9/8	9/11									
日銀当預残		5,426,200	5,405,300	5,402,300	5,391,400	5,414,400									
準備預金残		4,718,000	4,711,600	4,709,500	4,696,900	4,739,400									
マネタリーベース		6,683,300	6,662,400	6,659,400	6,648,200	6,670,200									
無担O/N加重平均		▲0.072%	▲0.076%	▲0.072%	▲0.066%	▲0.060%									
コール市場残高		202,113	189,220	185,662	171,907	177,992									
うち無担		173,963	158,837	156,664	140,845	148,998									
うちO/N		92,655	76,254	74,066	65,567	74,820									
うち有担		28,150	30,383	28,998	31,062	28,994									

## ●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	161	0.300%	25,000	2023/9/13	2028/6/20	89,137	20,190	100.02	0.295%	81.7630%	100.04	0.291%	4,793	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
国庫短期証券買入	1,000	2023/9/13			3,332	1,001	0.010		0.017	5.2
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/9/13		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		2023/9/13		0.534	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		2023/9/13		0.505	0	0				
米ドル資金供給		2023/9/14	2023/9/21	5.590	7	7				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/12	2023/9/13	▲0.350	26,463	26,463		▲0.350	▲0.352	
共通担保資金供給(全店)<固定金利・金額無制限>		2023/9/13	2023/9/27	0.000	9,362	9,362				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/12	2023/9/13	▲0.350	193	193		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/9/13	2023/9/22		6	6		▲0.100	▲0.100	

\*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13日の予定

*8月の企業物価指数	*8月の米消費者物価指数
*7-9月期の法人企業景気予測調査季報	*8月の米財政収支

◆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