

# Central Daily Market Report

2023年9月13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13日 需給速報	2023年9月14日 需給予想	2023年9月15日 当社予想			
銀行券	100	▲ 300	1,000			
財政	▲ 25,600	3,200	▲ 13,000			
資金過不足	▲ 25,500	2,900	▲ 12,000			
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			13,400			
CP等買入	4,000	▲ 100	▲ 500			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						▲ 13,000
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	▲ 27,000	26,300	27,000			
当預増減	▲ 20,700	42,700	▲ 25,000			
当座預金残高	5,394,500	5,437,200	5,412,200			
準備預金残高	4,778,800					
積み終了先	4,778,700			9月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,778,700			積数	100	
非準備預金先	615,700			1日平均	0	
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	93.55%		

## ●2023年9月13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▲0.020~▲0.010%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、▲0.09~▲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>

13日のアウトラ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、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。

## ●2023年9月14日の予定

- \*7月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲0.9%)
- \*ECB定例理事会(金融政策発表)
- \*8月の米生産者物価指数
- \*8月の米小売売上高
- \*7月の米企業在庫
- \*20年利付国債入札(12,000億円、9/15発行)

## ●短期金融市場関連指標

2023/9/13	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	▲ 0.016					-	▲ 0.092	0.705	0.000	32,706.52	▲ 69.85	147.15-17	147.26-28
T/N								-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.055	0.001	▲ 0.015					-	▲ 0.114						
2W	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.033					-	▲ 0.122						
3W								-	▲ 0.149						
1M								-	▲ 0.149						
3M			0.025					▲ 0.145	▲ 0.136						
6M								▲ 0.150	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.085						
日付		9/6	9/7	9/8	9/11	9/12									
日銀当預残		5,405,300	5,402,300	5,391,400	5,414,400	5,415,200									
準備預金残		4,711,600	4,709,500	4,696,900	4,739,400	4,741,800									
マネタリーベース		6,662,400	6,659,400	6,648,200	6,670,200	6,670,200									
無担O/N加重平均		▲0.076%	▲0.072%	▲0.066%	▲0.060%	▲0.048%									
コール市場残高		189,220	185,662	171,907	177,992	177,534									
うち無担		158,837	156,664	140,845	148,998	147,578									
うちO/N		76,254	74,066	65,567	74,820	75,170									
うち有担		30,383	28,998	31,062	28,994	29,956									

## ●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		2023/9/14		0.295						
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/9/14		0.535						
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/9/14		0.505						
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/9/14			5,874	1,504	0.000		0.009	26.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/9/14			5,244	4,251	▲0.010		▲0.004	4.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/9/14			17,020	6,763	▲0.013		▲0.011	85.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/9/14			1,435	1,001	▲0.036		▲0.022	85.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/13	2023/9/14	▲0.350	27,441	27,441		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/13	2023/9/14	▲0.350	0	0				

\*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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2023/9/15	2027/9/15	0%	35,448

- ◆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