

# Central Daily Market Report

2023年9月14日(木)  
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14日 需給速報	2023年9月15日 需給予想	2023年9月19日 当社予想			
銀行券	▲ 300	300	1,000			
財政	5,500	▲ 4,600	15,000			
資金過不足	5,200	▲ 4,300	16,000			
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	13,400					
CP等買入		▲ 500		▲ 700		
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		▲ 100		▲ 900		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 26,500	27,000		26,500		
当預増減	18,500	49,200		16,000		
当座預金残高	5,413,000	5,462,200		5,478,200		
準備預金残高	4,784,500					
積み終了先	4,784,500			9月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,784,500			積数	0	
非準備預金先	628,500			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	96.77%	

## ●2023年9月14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▲0.010~▲0.003%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、▲0.115~▲0.10%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>

14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

2023/9/14	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	▲ 0.012					-	▲ 0.091	0.705	0.000	33,168.10	461.58	147.32-34	147.27-29
T/N			▲ 0.020					-	▲ 0.105						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.030	▲ 0.047					-	▲ 0.118						
2W	▲ 0.035	0.010	▲ 0.022					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.152						
1M								-	▲ 0.150						
3M								▲ 0.145	▲ 0.135						
6M								▲ 0.150	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.085						
日付		9/7	9/8	9/11	9/12	9/13									
日銀当預残	5,402,300	5,391,400	5,414,400	5,415,200	5,394,500										
準備預金残	4,709,500	4,696,900	4,739,400	4,741,800	4,778,900										
マネタリーベース	6,659,400	6,648,200	6,670,200	6,670,200	6,649,400										
無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.066%	▲0.060%	▲0.048%	▲0.016%										
コール市場残高	185,662	171,907	177,992	177,534	171,645										
うち無担	156,662	140,845	148,998	147,578	141,859										
うちO/N	74,066	65,567	74,820	75,170	69,401										
うち有担	28,998	31,062	28,994	29,956	29,786										

## ●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	棄分率	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)
20年利付国債	185	1.100%	12,000	2023/9/15	2043/6/20	38,238	9,700	94.80	1.437%	89.3009%	94.87	1.433%	2,293

## ●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		2023/9/15		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		2023/9/15		0.535	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		2023/9/15		0.505	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/14	2023/9/15	▲0.350	26,879	26,879		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)<金利入札方式>	10,000	2023/9/15	2028/9/15		37,318	10,005			0.208	6.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/14	2023/9/15	▲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。

## ●2023年9月15日の予定

*7月の第3次産業活動指数	*8月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1182回)入札
*7月の石油等消費動態統計	*9月のミシガン消費者信頼感指数速報	(3ヶ月、56,000億円、9/19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