

# Central Daily Market Report

2023年9月29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29日 需給速報	2023年10月2日 需給予想	2023年10月3日 当社予想			
銀行券	100	400	500			
財政	▲ 4,400	▲ 22,900	▲ 8,000			
資金過不足	▲ 4,300	▲ 22,500	▲ 7,500			
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						
国債買入		3,000				
CP等買入	4,000	▲ 6,500	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 48,400	33,500	48,400			
当預増減	▲ 21,700	28,700	▲ 7,500			
当座預金残高	5,472,000	5,500,700	5,493,200			
準備預金残高	4,799,300					
積み終了先	4,798,600			10月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,794,000			積数	4,400	
非準備預金先	672,700			1日平均	300	
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	99.89%	日数	53.33%		

## ●2023年9月29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~▲0.055%近辺での出会いとなった。例年9月末日は、ビッドサイドを中心に取引を控える先が多くなるが、今回はオファーサイドでも運用を見合わせた先が複数みられた。一方で、ビッドサイドには地銀業態からの調達が一定量みられた事から、レート水準は前日比で概ね横ばい近辺で推移する展開となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.18~▲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>

29日はTB3M物(第1185回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。この他、1Y物でも出会いが見られた。

### <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

2023/9/29	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	▲ 0.062				-	▲ 0.551	0.765	0.010	31,857.62	▲ 14.90	149.33-35	148.76-78
T/N							-	▲ 0.135						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.037	▲ 0.041				-	▲ 0.139						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.156						
3W							-	▲ 0.159						
1M	▲ 0.010	0.030	0.014				-	▲ 0.155						
3M							▲ 0.308	▲ 0.182						
6M							▲ 0.155	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.084						
									日付	9/22	9/25	9/26	9/27	9/28
									日銀当預残	5,481,600	5,494,100	5,506,500	5,486,000	5,493,700
									準備預金残	4,796,300	4,807,000	4,800,900	4,788,000	4,796,300
									マネタリーベース	6,736,000	6,747,900	6,760,400	6,739,900	6,747,900
									無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.042%	▲0.051%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	214,493	208,249	226,934	226,543	237,690
									うち無担	188,552	180,404	205,074	203,706	215,795
									うちO/N	104,799	100,201	117,461	112,213	125,522
									うち有担	25,941	27,845	21,860	22,837	21,895

## ●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	乗分率	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	1185	-	56,000	2023/10/2	2024/1/9	147,807	45,600.7	100.0670	▲0.2468%	83.9168%	100.0729	▲0.2685%	10,399
交付税特会	-	-	13,000	2023/10/11	2024/4/11	451,440	13,000.26		0.000%	2.8804%		0.000%	

## ●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		2023/10/2		0.245	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		2023/10/2		0.455	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/29	2023/10/2	▲0.750	48,608	48,608		▲0.750	▲0.751	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/10/2			9,812	3,007	0.006		0.008	32.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/29	2023/10/2	▲0.750	732	732		▲0.750	▲0.750	

\*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10月2日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨) *決定会合における主な意見(9月21、22日分)	*9月のISM製造業景況指数 *8月の米建設支出
--	-----------------------------

◆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