

# Central Daily Market Report

2023年10月3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10月3日 需給速報	2023年10月4日 需給予想	2023年10月5日 当社予想			
銀行券	200	0	▲ 1,000			
財政	▲ 16,200	▲ 68,700	2,000			
資金過不足	▲ 16,000	▲ 68,700	1,000			
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						
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			▲ 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	▲ 38,000	40,400		38,000		
当預増減	▲ 13,600	▲ 29,800				1,000
当座預金残高	5,441,600	5,411,800				5,412,800
準備預金残高	4,732,000					
積み終了先	4,731,100			10月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,731,100			積数		2,700
非準備預金先	709,600			1日平均		200
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	99.93%		日数		60.00%

## ●2023年10月3日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.087~▲0.02%近辺の出会いが始まった。ビッドサイドの旺盛な資金調達ニーズを受け、オファーサイドからは目線を切り上げる動きが見られ、レートは上昇した。一巡後も朝方と同水準の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.155~▲0.12%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>

3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、弱めの結果となった。マーケットで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、数件の入札が実施された。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

2023/10/3	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	
	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	▲ 0.031				-	▲ 0.122	0.760	▲ 0.010	31,237.94	▲ 521.94	149.85-87	149.77-79
T/N							-	▲ 0.150						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.025	▲ 0.026				-	▲ 0.162						
2W	▲ 0.029	▲ 0.023	▲ 0.026				-	▲ 0.163						
3W							-	▲ 0.170						
1M			▲ 0.027				-	▲ 0.181						
3M							▲ 0.308	▲ 0.201						
6M							▲ 0.155	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.095	▲ 0.087						
日付	9/26	9/27	9/28	9/29	10/2									
日銀当預残	5,506,500	5,486,000	5,493,700	5,472,000	5,455,200									
準備預金残	4,800,900	4,788,000	4,796,300	4,799,300	4,760,000									
マネタリーベース	6,760,400	6,739,900	6,747,900	6,726,100	6,708,900									
無担O/N加重平均	▲ 0.051%	▲ 0.064%	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.044%									
コール市場残高	226,934	226,543	237,690	142,574	185,184									
うち無担	205,074	203,706	215,795	122,880	158,378									
うちO/N	117,461	112,213	125,522	77,037	93,240									
うち有担	21,860	22,837	21,895	19,694	26,806									

## ●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非面価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	372	0.800%	27,000	2023/10/4	2033/9/20	85,697	21,785	100.27	0.770%	8.3721%	100.29	0.768%	5,196	13,444

## ●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*	申込総額(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	2023/10/4			6,645	1,001	0.010		0.013	61.1
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/10/4		0.230	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		2023/10/4		0.430	0	0				
米ドル資金供給		2023/10/5	2023/10/12	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/3	2023/10/4	▲ 0.350	38,730	38,730		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/3	2023/10/4	▲ 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4日の予定

*10月の日銀当座預金増減要因見込み	*9月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入(13,000億円、10/16借入)
	*8月の米製造業新規受注・出荷・在庫	

◆本資料は信頼できるとさ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