

# Central Daily Market Report

2023年10月10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10日 需給速報	2023年10月11日 需給予想	2023年10月12日 当社予想			
銀行券	200	500	1,000			
財政	▲ 5,600	▲ 3,800	▲ 26,000			
資金過不足	▲ 5,400	▲ 3,300	▲ 25,000			
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	6,400	▲ 8,500			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		14,100				
CP等買入		▲ 100	▲ 500			
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	▲ 43,200	40,100	43,200			
当預増減	1,400	51,400	▲ 25,000			
当座預金残高	5,382,100	5,433,500	5,408,500			
準備預金残高	4,722,500					
積み終了先	4,722,400			10月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,722,400			積数	300	
非準備預金先	659,600			1日平均	100	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,887,300	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	83.33%		

## ●2023年10月10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▲0.05~▲0.015%近辺の出会いが始まった。連休4日積み要因の剥落や、積みの進捗に目途が付きつつある先もあり、ビッドの水準は前営業日比で低下する展開となった。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、▲0.11~▲0.095%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>

10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。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

2023/10/10	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	▲ 0.030				-	▲ 0.101	0.770	▲ 0.028	31,746.53	751.86	148.33-34	148.95-97
T/N							-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.035				-	▲ 0.146						
2W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.161						
3W							-	▲ 0.168						
1M							-	▲ 0.177						
3M	0.001	0.030	0.016				▲ 0.208	▲ 0.200						
6M							▲ 0.171	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.095	▲ 0.086						
日付	10/2	10/3	10/4	10/5	10/6									
日銀当預残	5,455,200	5,441,600	5,372,200	5,391,800	5,380,700									
準備預金残	4,760,000	4,732,000	4,693,000	4,708,700	4,714,500									
マネタリーベース	6,708,900	6,695,200	6,625,800	6,645,600	6,634,500									
無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.031%	▲0.021%	▲0.015%	▲0.016%									
コール市場残高	185,184	203,125	212,513	207,889	209,815									
うち無担	158,378	175,480	185,815	181,595	183,069									
うちO/N	93,240	104,632	114,212	108,587	109,651									
うち有担	26,806	27,645	26,698	26,294	26,746									

## ●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		2023/10/11		0.202	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		2023/10/11		0.420	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/10/11			10,415	4,253	▲0.008		▲0.006	2.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/10/11			14,421	6,762	▲0.038		▲0.037	91.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/10/11			5,294	2,007	▲0.032		▲0.031	59.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/10/11			3,481	1,005	▲0.032		▲0.031	56.5
米ドル資金供給		2023/10/12	2023/10/19	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/10	2023/10/11	▲0.350	44,079	44,079		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/10/11	2023/10/25	0.000	6,360	6,360				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/10	2023/10/11	▲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372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11日の予定

*9月の米生産者物価指数	*5年利付国債入札 (25,000億円、10/12発行)	*エネルギー対策借入 (6,200億円、10/20借入)
--------------	---------------------------------	---------------------------------

◆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