

# Central Daily Market Report

2023年10月11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10月11日 需給速報	2023年10月12日 需給予想	2023年10月13日 当社予想			
銀行券	500	▲ 900	▲ 500			
財政	▲ 3,700	▲ 17,700	77,000			
資金過不足	▲ 3,200	▲ 18,600	76,500			
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	6,400	▲ 8,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	14,100					
CP等買入		▲ 500	▲ 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						
国債補充供給	▲ 42,600	43,200	42,600			
当預増減	8,900	24,900	76,500			
当座預金残高	5,391,000	5,415,900	5,492,400			
準備預金残高	4,709,400					
積み終了先	4,709,400			10月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,709,400			積数	200	
非準備預金先	681,600			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	86.67%		

## ●2023年10月11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▲0.06~▲0.025%近辺の出会いが始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで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、▲0.11%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>

11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。発行レートは横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/10/11	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	▲ 0.033				-	▲ 0.112	0.770	0.000	31,936.51	189.98	148.61-63	148.76-78
T/N							-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	0.200	0.038				-	▲ 0.148						
2W							-	▲ 0.168						
3W							-	▲ 0.172						
1M							-	▲ 0.184						
3M							▲ 0.208	▲ 0.199						
6M							▲ 0.171	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.095	▲ 0.086						
									日付	10/3	10/4	10/5	10/6	10/10
									日銀当預残	5,441,600	5,372,200	5,391,800	5,380,700	5,382,100
									準備預金残	4,732,000	4,693,000	4,708,700	4,714,500	4,713,100
									マネタリーベース	6,695,200	6,625,800	6,645,600	6,634,500	6,635,700
									無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.021%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.030%
									コール市場残高	203,125	212,513	207,889	209,815	201,708
									うち無担	175,480	185,815	181,595	183,069	174,486
									うちO/N	104,632	114,212	108,587	109,651	101,238
									うち有担	27,645	26,698	26,294	26,746	27,222

## ●入札結果

名称	回数	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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非簿格競争入札(億円)	非簿格入札(億円)
5年利付国債	162	0.3%	25,000	2023/10/12	2028/9/20	82,111	20,243	99.83	0.334%	84.0897%	99.85	0.330%	4,736	13.3
エネルギー対策	-	-	6,200	2023/10/20	2024/10/21	136,400	6,199.82		0.000%	4.5454%		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
国庫短期証券買入	1,000	2023/10/12			6,357	1,000	0.021		0.022	36.7
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/10/12		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		2023/10/12		0.455	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/11	2023/10/12	▲0.350	43,344	43,344		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/11	2023/10/12	▲0.350	0	0				

\*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12日の予定

*9月の企業物価指数 *8月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+0.4%)	*9月の米消費者物価指数 *9月の米財政収支
---	---------------------------

◆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