

# Central Daily Market Report

2023年10月16日(月)

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16日 需給速報	2023年10月17日 需給予想	2023年10月18日 当社予想			
銀行券	800	100	▲ 500			
財政	▲ 800	300	▲ 12,000			
資金過不足	0	400	▲ 12,500			
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		16,600				
CP等買入	▲ 100	4,000				
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	▲ 35,700	37,200		35,700		
当預増減	1,400	56,700	▲ 12,500			
当座預金残高	5,456,100	5,512,800	5,500,300			
準備預金残高	4,755,100					
積み終了先	3,052,700			10月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,336,800			積数	588,200	
非準備預金先	701,000			1日平均	19,600	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					4,006,500	
準備預金進捗率	実績	85.32%	日数	3.23%		

## ●2023年10月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担ON物は、国内勢を中心に▲0.050~▲0.020%近辺の出会いが始まった。新積み期間に入り、基準比率の上昇などを背景に積極的な調達が見られ、ビッド水準は上昇する展開となった。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▲0.030~▲0.020%近辺で散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.12~▲0.09%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>

16日のアウトラ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

2023/10/16	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	▲ 0.028				-	▲ 0.097	0.750	▲ 0.008	31,659.03	▲ 656.96	149.55-57	149.56-58
T/N							-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.010	▲ 0.026				-	▲ 0.145						
2W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.161						
3W							-	▲ 0.169						
1M	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.024				-	▲ 0.178						
3M			0.010				▲ 0.215	▲ 0.197						
6M							▲ 0.171	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.100	▲ 0.086						
日付	10/6	10/10	10/11	10/12	10/13									
日銀当預残	5,380,700	5,382,100	5,391,000	5,372,200	5,454,700									
準備預金残	4,714,500	4,713,100	4,709,400	4,698,100	4,751,000									
マネタリーベース	6,634,500	6,635,700	6,644,100	6,626,300	6,708,300									
無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.030%	▲ 0.033%	▲ 0.029%	▲ 0.019%									
コール市場残高	209,815	201,708	204,943	206,275	193,131									
うち無担	183,069	174,486	177,055	177,901	165,524									
うちO/N	109,651	101,238	104,007	104,953	95,876									
うち有担	26,746	27,222	27,888	28,374	27,607									

## ●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)	発札総額(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	平均発札レート・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		2023/10/17		0.242	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		2023/10/17		0.476	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/10/17			11,428	4,253	▲ 0.003		▲ 0.002	69.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/10/17			10,820	4,505	▲ 0.007		▲ 0.005	48.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/10/17			11,484	6,756	▲ 0.014		▲ 0.011	9.4
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/10/17			2,748	1,006	0.011		0.011	67.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/16	2023/10/17	▲ 0.350	36,260	36,260		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/16	2023/10/17	▲ 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17日の予定

*8月の第3次産業活動動向	*9月の米小売売上高	*20年利付国債入札
*8月の石油等消費動態統計	*9月の米鉱工業生産・設備稼働率	(12,000億円、10/18発行)
	*8月の米企業在庫	

◆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