

# Central Daily Market Report

2023年10月17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17日 需給速報	2023年10月18日 需給予想	2023年10月19日 当社予想			
銀行券	100	▲ 400	▲ 1,000			
財政	800	▲ 9,100	2,000			
資金過不足	900	▲ 9,500	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	16,600					
CP等買入	4,000		▲ 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			▲ 300			
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 35,000	35,700	35,000			
当預増減	22,200	26,100	1,000			
当座預金残高	5,478,300	5,504,400	5,505,400			
準備預金残高	4,768,400					
積み終了先	4,690,600			10月18日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,283,900			積数	99,200	
非準備預金先	709,900			1日平均	3,400	
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	97.52%	日数	6.45%		

## ●2023年10月17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▲0.040~▲0.005%近辺の出会いが始まった。一部の先から積極的な調達が見られた事で、ビッド水準は前日対比で上昇した。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▲0.020~▲0.010%近辺で散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲0.10%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>

17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

2023/10/17	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		
	単位：%	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	▲ 0.015					-	▲ 0.096	0.780	0.030	32,040.29	381.26	149.57-59	149.59-61
T/N								-	▲ 0.107						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.018	▲ 0.027					-	▲ 0.147						
2W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.014					-	▲ 0.161						
3W								-	▲ 0.169						
1M	▲ 0.023	▲ 0.003	▲ 0.012					-	▲ 0.181						
3M								▲ 0.215	▲ 0.198						
6M								▲ 0.171	▲ 0.127						
1Y								▲ 0.100	▲ 0.087						
										日付	10/10	10/11	10/12	10/13	10/16
										日銀当預残	5,382,100	5,391,000	5,372,200	5,454,700	5,456,100
										準備預金残	4,713,100	4,709,400	4,698,100	4,751,000	4,755,100
										マネタリーベース	6,635,700	6,644,100	6,626,300	6,708,300	6,708,900
										無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.033%	▲0.029%	▲0.019%	▲0.028%
										コール市場残高	201,708	204,943	206,275	193,131	178,461
										うち無担	174,486	177,055	177,901	165,524	150,018
										うちO/N	101,238	104,007	104,953	95,876	84,185
										うち有担	27,222	27,888	28,374	27,607	28,443

## ●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I非価格競争入札(億円)
20年利付国債	186	1.5%	12,000	2023/10/18	2043/9/20	28,838	9,701	98.65	1.589%	2.8688%	99.18	1.553%	2,295

## ●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	2023/10/18			6,017	1,001	0.017		0.021	92.2
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/10/18		0.250	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		2023/10/18		0.485	0	0				
米ドル資金供給		2023/10/19	2023/10/26	5.580	3	3				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/17	2023/10/18	▲0.350	35,552	35,552		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/17	2023/10/18	▲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18日の予定

*9月の米住宅着工件数	*米ページブック	*9月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*9月の英消費者物価指数
-------------	----------	--------------------	--------------

◆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