

# Central Daily Market Report

2023年10月23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23日 需給速報	2023年10月24日 需給予想	2023年10月25日 当社予想			
銀行券	100	▲ 200	▲ 1,000			
財政	10,400	3,800	3,000			
資金過不足	10,500	3,600	2,000			
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						▲ 6,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		17,600				
CP等買入		▲ 300	▲ 400			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			1,000			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 33,200	34,100	33,200			
※下り資金需給用担保債供給						
当預増減	11,100	55,000	▲ 4,400			
当座預金残高	5,481,300	5,536,300	5,531,900			
準備預金残高	4,791,400					
積み終了先	4,788,800			10月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,788,300			積数	22,500	
非準備預金先	689,900			1日平均	1,000	
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	99.44%	日数	25.81%		

## ●2023年10月23日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.01~▲0.005%程度での出合いが始まった。3日積み要因は剥落したものの、引き続き積極的な調達姿勢が見られたことから、レートは前営業日対比で概ね横ばい圏での推移となった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで取引を終えた。  
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、▲0.10~▲0.09%程度での出合いとなった。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>

23日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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

2023/10/23	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.012					-	▲ 0.098	0.860	0.025	30,999.55	▲ 259.81	149.86-88	149.90-92
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.020					-	▲ 0.130						
2W	▲ 0.020	0.005	▲ 0.017					-	▲ 0.151						
3W								-	▲ 0.159						
1M								-	▲ 0.168						
3M								▲ 0.203	▲ 0.193						
6M								▲ 0.171	▲ 0.116						
1Y								▲ 0.054	▲ 0.082						
日付		10/16	10/17	10/18	10/19	10/20									
日銀当預残		5,456,100	5,478,300	5,466,400	5,475,100	5,470,200									
準備預金残		4,755,100	4,768,400	4,762,200	4,790,000	4,791,300									
マネタリーベース		6,708,900	6,731,000	6,719,400	6,729,100	6,724,300									
無担O/N加重平均		▲0.028%	▲0.015%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%									
コール市場残高		178,461	187,425	188,563	177,162	177,856									
うち無担		150,018	159,159	160,274	149,632	150,250									
うちO/N		84,185	94,561	93,027	81,185	81,703									
うち有担		28,443	28,266	28,289	27,530	27,606									

## ●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	棄分率	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		2023/10/24		0.165	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		2023/10/24		0.400	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/10/24			11,523	4,254	0.007		0.009	94.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/10/24			11,708	4,506	0.006		0.008	27.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/10/24			13,908	6,757	0.010		0.012	60.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/10/24			4,753	2,004	0.030		0.033	58.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/23	2023/10/24	▲0.350	33,857	33,857		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/23	2023/10/24	▲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24日の予定

*特にありません
----------

◆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