

# Central Daily Market Report

2023年10月13日(金)

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13日 需給速報	2023年10月16日 需給予想	2023年10月17日 当社予想			
銀行券	400	800	1,000			
財政	76,200	900	2,000			
資金過不足	76,600	1,700	3,000			
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 200	▲ 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		▲ 1,200				
気候変動対応オペ						
E T F 買入	700					
国債補完供給	▲ 37,200	43,800	37,200			
当増減	82,500	38,800	7,000			
当座預金残高	5,454,700	5,493,500	5,500,500			
準備預金残高	4,751,000					
積み終了先	4,751,000			10月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,750,900			積数	4,006,500	
非準備預金先	703,700			1日平均	129,200	
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	0.00%	日数	0.00%		

## ●2023年10月13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▲0.060~▲0.008%近辺の出合いで始まった。積み最終日となり、最終調整による調達のため、取引開始直後からテイクン地合いとなった。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、▲0.12~▲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>

13日はTB3M物(第1188回)の入札が実施され、落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

### <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

2023/10/13	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	売買参考統計値	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	▲0.019				-	▲0.101	0.758	0.008	32,315.99	▲178.67	149.78-80	149.64-67
T/N			▲0.025				-	▲0.122						
S/N			▲0.005				-	-						
1W	▲0.040	▲0.012	▲0.038				-	▲0.148						
2W	▲0.040	0.005	▲0.032				-	▲0.166						
3W			0.001				-	▲0.177						
1M	▲0.020	▲0.007	▲0.014				-	▲0.188						
3M	0.004	0.028	0.018				▲0.215	▲0.199						
6M							▲0.171	▲0.126						
1Y							▲0.095	▲0.086						
日付	10/5	10/6	10/10	10/11	10/12									
日銀当預残	5,391,800	5,380,700	5,382,100	5,391,000	5,372,200									
準備預金残	4,708,700	4,714,500	4,713,100	4,709,400	4,698,100									
マネタリーベース	6,645,600	6,634,500	6,635,700	6,644,100	6,626,300									
無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.016%	▲0.030%	▲0.033%	▲0.029%									
コール市場残高	207,889	209,815	201,708	204,943	206,275									
うち無担	181,595	183,069	174,486	177,055	177,901									
うちO/N	108,587	109,651	101,238	104,007	104,953									
うち有担	26,294	26,746	27,222	27,888	28,374									

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1188	-	56,000	2023/10/16	2024/1/22	139,495	45,390.6	100.0490	▲0.1824%	93.0709%	100.0530	▲0.1972%	10,609	
交付税特会	-	-	13,000	2023/10/24	2024/4/24	474,865	12,990.1		0.000%	2.7356%		0.000%		10

## ●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		2023/10/16		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		2023/10/16		0.495	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/13	2023/10/16	▲0.350	37,795	37,795		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/13	2023/10/16	▲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16日の予定

\*特にありません

◆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