

# Central Daily Market Report

2023年10月18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18日 需給速報	2023年10月19日 需給予想	2023年10月20日 当社予想			
銀行券	▲ 400	▲ 1,000	▲ 1,000			
財政	▲ 11,800	8,800	1,000			
資金過不足	▲ 12,200	7,800	0			
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		3,900				
CP等買入		▲ 100	▲ 300			
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	▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 35,300	35,000	35,300			
※下の資金供給は総務課提供額						
当預増減	▲ 11,900	46,600	0			
当座預金残高	5,466,400	5,513,000	5,513,000			
準備預金残高	4,762,200					
積み終了先	4,736,200			10月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,718,600			積数	55,600	
非準備預金先	704,200			1日平均	2,000	
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	98.61%	日数	9.68%		

## ●2023年10月18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▲0.020~▲0.005%近辺の出会いが始まった。引き続き積極的な調達が見られたことで、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、▲0.105~▲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>

18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

2023/10/18	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)
単位: %									0.805	0.025	32,042.25	1.96	149.74-76	149.74-76
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.096						
T/N							-	▲ 0.105						
S/N			▲ 0.020				-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.023				-	▲ 0.146						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.015				-	▲ 0.162						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.168						
1M							-	▲ 0.177						
3M							▲ 0.215	▲ 0.197						
6M							▲ 0.171	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.100	▲ 0.086						
日付		10/11	10/12	10/13	10/16	10/17								
日銀当預残	5,391,000	5,372,200	5,454,700	5,456,100	5,478,300									
準備預金残	4,709,400	4,698,100	4,751,000	4,755,100	4,768,400									
マネタリーベース	6,644,100	6,626,300	6,708,300	6,708,900	6,731,000									
無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.029%	▲0.019%	▲0.028%	▲0.015%									
コール市場残高	204,943	206,275	193,131	178,461	187,425									
うち無担	177,055	177,901	165,524	150,018	159,159									
うちO/N	104,007	104,953	95,876	84,185	94,561									
うち有担	27,888	28,374	27,607	28,443	28,266									

## ●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)	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		2023/10/19		0.220	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		2023/10/19		0.465	0	0				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/10/19			9,092	3,010	0.026		0.028	63.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2023/10/19			2,647	1,005	0.045		0.049	23.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/18	2023/10/19	▲0.350	35,862	35,862		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/18	2023/10/19	▲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19日の予定

*9月の貿易統計	*9月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1189回)入札 (1年、35,000億円、10/20発行)
		*流動性供給入札 (5,000億円、10/20発行)

◆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