

Central Daily Market Report

2023年11月1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11月1日 需給速報	2023年11月2日 需給予想	2023年11月6日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 500	▲ 300			
財政	▲ 33,500	▲ 2,600	▲ 25,000			
資金過不足	▲ 34,400	▲ 3,100	▲ 25,300			
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		4,000				
CP等買入		▲ 200	▲ 200			
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	▲ 36,900	53,000	36,900			
当増減	▲ 18,500	37,600	▲ 25,300			
当座預金残高	5,498,600	5,536,200	5,510,900			
準備預金残高	4,794,100					
積み終了先	4,793,100			11月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,793,100			積数	7,400	
非準備預金先	704,500			1日平均	500	
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	99.82%	日数	54.84%		

●2023年11月1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▲0.015~▲0.012%近辺での出会いとなった。月末要因の剥落により、調達を再開する先が見られたことでビッドサイドの厚みが増した結果、レート水準は前日比で若干上昇する流れとなった。ターム物はショートターム物での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.14%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>

1日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、入札件数が少なく閑散となるなか、一部業態から大型発行が見られた。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

2023/11/1	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	▲ 0.016				-	▲ 0.103	0.955	0.006	31,601.65	742.80	151.30-32	151.37-39
T/N			▲ 0.020				-	▲ 0.140						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.026				-	▲ 0.158						
2W	▲ 0.020	0.030	▲ 0.011				-	▲ 0.163						
3W							-	▲ 0.169						
1M	▲ 0.010	0.020	0.002				-	▲ 0.175						
3M			0.028				▲ 0.200	▲ 0.187						
6M							▲ 0.167	▲ 0.118						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.084						
									日付	10/25	10/26	10/27	10/30	10/31
									日銀当預残	5,516,400	5,512,600	5,504,000	5,523,600	5,517,100
									準備預金残	4,809,200	4,818,600	4,808,200	4,816,200	4,803,400
									マネタリーベース	6,770,800	6,768,300	6,760,100	6,779,400	6,773,000
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.019%	▲0.013%	▲0.016%	▲0.020%
									コール市場残高	178,539	181,825	184,039	183,872	198,150
									うち無担	150,159	153,919	156,534	157,667	173,513
									うちO/N	78,452	82,212	84,687	87,055	107,111
									うち有担	28,380	27,906	27,505	26,205	24,637

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/1	2023/11/2	▲0.450	37,938	37,938		▲0.450	▲0.451	
国債買入(残存期間3年超5年以下)	1,000	2023/11/2			4,229	1,003	0.020		0.023	24.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/11/2			7,777	3,009	0.013		0.016	18.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/1	2023/11/2	▲0.450	0	0				

●2023年11月2日の予定

*10月のマネタリーベース	*英中銀MPC結果発表	*国庫短期証券(1192回)入札
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*9月の米製造業新規受注・出荷・在庫	(3ヶ月、56,000億円、11/6発行)
		*10年利付国債入札
		(27,000億円、11/6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