

Central Daily Market Report

2023年11月2日(木)
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2日 需給速報	2023年11月6日 需給予想	2023年11月7日 当社予想			
銀行券	▲ 400	400	700			
財政	▲ 4,700	▲ 27,900	1,000			
資金過不足	▲ 5,100	▲ 27,500	1,700			
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				
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	▲ 44,300	36,900		44,300		
当預増減	▲ 8,700	16,800		1,700		
当座預金残高	5,489,900	5,506,700		5,508,400		
準備預金残高	4,779,600					
積み終了先	4,779,200			11月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,778,700			積数	3,700	
非準備預金先	710,300			1日平均	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	99.91%		日数	67.74%	

●2023年11月2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▲0.010~▲0.006%近辺での出会いとなった。連休前の週末4日積みとなったことから、積極的に取り上がる先も散見されたため、レート水準は前日比で一段と上昇する展開となった。ターム物はショートターム物で散発的に出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.16~▲0.115%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>

2日はTB3M物(第1192回)の入札が実施され、小じっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでも堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2023/11/2	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	▲ 0.011				-	▲ 0.155	0.915	▲ 0.040	31,949.89	348.24	150.56-59	150.38-40
T/N							-	▲ 0.149						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.024				-	▲ 0.157						
2W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.164						
3W							-	▲ 0.168						
1M	▲ 0.013	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.175						
3M							▲ 0.204	▲ 0.189						
6M							▲ 0.167	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.083						
									日付	10/26	10/27	10/30	10/31	11/1
									日銀当預残	5,512,600	5,504,000	5,523,600	5,517,100	5,498,600
									準備預金残	4,818,600	4,808,200	4,816,200	4,803,400	4,794,300
									マネタリーベース	6,768,300	6,760,100	6,779,400	6,773,000	6,755,400
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.013%	▲0.016%	▲0.020%	▲0.016%
									コール市場残高	181,825	184,039	183,872	198,150	193,072
									うち無担	153,919	156,534	157,667	173,513	166,662
									うちO/N	82,212	84,687	87,055	107,111	97,295
									うち有担	27,906	27,505	26,205	24,637	26,410

●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1192	-	56,000	2023/11/6	2024/2/13	142,500	45,471.3	100.0490	▲0.1805%	7.1523%	100.0509	▲0.1875%	10,528	
10年利付国債	372	0.8%	27,000	2023/11/6	2033/9/20	78,894	21,784	98.95	0.915%	7.4052%	99.00	0.910%	5,193	15,28

●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)		2023/11/2	2023/11/6	▲ 0.350	45,431	45,431		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/2	2023/11/6	▲ 0.350	0	0				

●2023年11月3日の予定

*文化の日

●2023年11月6日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(9月21・22日分)
*11月の日銀当座預金増減要因見込み

◆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