

Central Daily Market Report

2023年11月6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11月6日 需給速報	2023年11月7日 需給予想	2023年11月8日 当社予想			
銀行券	300	1,000	300			
財政	▲ 31,000	▲ 600	▲ 2,500			
資金過不足	▲ 30,700	400	▲ 2,200			
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						▲ 7,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		18,600				
CP等買入						
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	▲ 41,100	44,300		41,100		
当預増減	▲ 27,500	60,100		▲ 9,300		
当座預金残高	5,462,400	5,522,500		5,513,200		
準備預金残高	4,772,300					
積み終了先	4,771,800			11月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,771,800			積数	3,200	
非準備預金先	690,100			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	99.92%		日数	70.97%	

●2023年11月6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~▲0.007%近辺での出会いとなった。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、▲0.17~▲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>

6日のアウトライ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、数件の入札が実施された。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

2023/11/6	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.128	0.870	▲ 0.045	32,708.48	758.59	149.45-46	149.73-74
T/N							-	▲ 0.155						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.036				-	▲ 0.160						
2W	▲ 0.029	0.005	▲ 0.024				-	▲ 0.168						
3W							-	▲ 0.170						
1M			0.001				-	▲ 0.177						
3M							▲ 0.204	▲ 0.190						
6M							▲ 0.167	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.081						
									日付	10/27	10/30	10/31	11/1	11/2
									日銀当預残	5,504,000	5,523,600	5,517,100	5,498,600	5,489,900
									準備預金残	4,808,200	4,816,200	4,803,400	4,794,300	4,779,700
									マネタリーベース	6,760,100	6,779,400	6,773,000	6,755,400	6,747,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.016%	▲ 0.020%	▲ 0.016%	▲ 0.011%
									コール市場残高	184,039	183,872	198,150	193,072	195,825
									うち無担	156,534	157,667	173,513	166,662	170,205
									うちO/N	84,687	87,055	107,111	97,295	102,948
									うち有担	27,505	26,205	24,637	26,410	25,620

●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I非償額競争入札(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(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/11/7			7,961	4,253	▲0.015		▲0.014	94.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/11/7			7,609	4,503	▲0.033		▲0.031	61.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/11/7			8,333	6,751	▲0.054		▲0.045	60.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/11/7			4,069	2,006	▲0.054		▲0.051	47.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/11/7			1,941	1,004	▲0.043		▲0.039	55.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/6	2023/11/7	▲0.350	41,717	41,717		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/6	2023/11/7	▲0.350	436	436		▲0.350	▲0.351	

●2023年11月7日の予定

*9月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲2.7%)	*9月の米貿易収支 *9月の米消費者信用残高	*10年物価連動国債入札 (2,500億円、11/8発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、11/16借入)
-------------------------------------	---------------------------	----------------------------------------------------------------------

◆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