

# Central Daily Market Report

2023年11月9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9日 需給速報	2023年11月10日 需給予想	2023年11月13日 当社予想			
銀行券	▲ 100	900	500			
財政	1,000	▲ 14,300	2,000			
資金過不足	900	▲ 13,400	2,500			
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		▲ 100		▲ 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						
国債補充供給	▲ 37,800	39,100		37,800		
※以下は資金需給用控除後数値						
当預増減	2,100	24,200		2,500		
当座預金残高	5,485,900	5,510,100		5,512,600		
準備預金残高	4,783,000					
積み終了先	4,782,300			11月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,782,300			積数	1,600	
非準備預金先	702,900			1日平均	300	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額				4,009,200		
準備預金進捗率	実績	99.96%		日数	80.65%	

## ●2023年11月9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%前後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、▲0.15~▲0.12%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>

9日はTB6M物(第1193回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりと推移した。

### <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。  
また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円で実施され、按分レート▲0.003%、平均レート+0.004%と、前回(按分0.000%、平均+0.023%)比で、按分レート、平均レートともに低下する結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/11/9	無担(速報)			有担(速報)			短期	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
	単位：%	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		▲ 0.070	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.133	0.835	▲ 0.010	32,646.46	479.98	150.85-87	150.90-92
T/N				▲ 0.015				-	▲ 0.137						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.013	▲ 0.020					-	▲ 0.152						
2W								-	▲ 0.159						
3W								-	▲ 0.171						
1M				0.080				-	▲ 0.178						
3M								▲ 0.204	▲ 0.192						
6M								▲ 0.163	▲ 0.114						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.081						
										日付	11/1	11/2	11/6	11/7	11/8
										日銀当預残	5,498,600	5,489,900	5,462,400	5,477,800	5,483,800
										準備預金残	4,794,300	4,779,700	4,772,000	4,775,200	4,779,900
										マネタリーベース	6,755,400	6,747,000	6,719,300	6,733,700	6,739,000
										無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%
										コール市場残高	193,072	195,825	189,399	188,294	198,219
										うち無担	166,662	170,205	164,508	164,400	172,523
										うちO/N	97,295	102,948	96,571	95,413	105,205
										うち有担	26,410	25,620	24,891	23,894	25,696

## ●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1193	-	40,000	2023/11/10	2024/5/10	101,047	32,951.7	100.075	▲0.1502%	18.2056%	100.081	▲0.1623%	7,048
30年利付国債	80	1.8%	9,000	2023/11/10	2053/9/20	26,193	7,267	100.95	1.751%	6.2100%	101.15	1.741%	1,728
エネルギー対策	-	-	6,200	2023/11/20	2024/11/20	127,600	6,199.99		0.000%	5.3820%		0.000%	

## ●オペ結果

種類	オフター額(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
CP等買入	4,000	2023/11/14			7,578	3,995	▲0.003		0.004	0.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2023/11/9	2023/11/10	▲ 0.450	38,660	38,660		▲0.450	▲0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2023/11/9	2023/11/10	▲ 0.450	0	0				

## ●2023年11月10日の予定

*10月のマネーストック	*New York祝日(Veterans Day, observed)	*国庫短期証券(1194回)入札
*9月の特定サービス産業動態統計速報	*11月のミシガン大消費者信頼感指数速報	(3ヶ月、56,000億円、11/13発行)
	*7-9月期の英GDP速報値	

◆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たい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