

Central Daily Market Report

2023年11月10日(金)

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10日 需給速報	2023年11月13日 需給予想	2023年11月14日 当社予想			
銀行券	900	500	1,000			
財政	▲ 14,300	▲ 5,900	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 13,400	▲ 5,400	▲ 3,000			
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		12,100				
CP等買入		▲ 200	▲ 100	4,000		
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	▲ 40,600	37,800	40,600			
当預増減	▲ 16,400	47,200	1,000			
当座預金残高	5,469,500	5,516,700	5,517,700			
準備預金残高	4,760,400					
積み終了先	4,760,300			11月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,759,900			積数	100	
非準備預金先	709,100			1日平均	0	
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	100.00%	日数	90.32%		

●2023年11月10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▲0.020~▲0.010%程度での出会いとなった。一部大手行による資金運用ニーズの高まりから、レート水準が低下した。ターム物はショートターム物での引き合いが見えられた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13~▲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>

10日はTB3M物(第1194回)の入札が実施され、強い結果となった。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市場は、入札案件が少なく閑散な状況となった。発行レートの目線に変更はなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/11/10	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.137	0.850	0.015	32,568.11	▲ 78.35	151.33-35	151.38-39
T/N							-	▲ 0.125						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.024	▲ 0.029				-	▲ 0.149						
2W			▲ 0.013				-	▲ 0.158						
3W			0.005				-	▲ 0.167						
1M							-	▲ 0.174						
3M							▲ 0.220	▲ 0.193						
6M							▲ 0.170	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.081						
									日付	11/2	11/6	11/7	11/8	11/9
									日銀当預残	5,489,900	5,462,400	5,477,800	5,483,800	5,485,900
									準備預金残	4,779,700	4,772,000	4,775,200	4,779,900	4,783,100
									マネタリーベース	6,747,000	6,719,300	6,733,700	6,739,000	6,741,200
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.011%
									コール市場残高	195,825	189,399	188,294	198,219	197,823
									うち無担	170,205	164,508	164,400	172,523	171,636
									うちO/N	102,948	96,571	95,413	105,205	100,458
									うち有担	25,620	24,891	23,894	25,696	26,187

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回/利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1194	-	56,000	2023/11/13	2024/2/19	171,820	45,471.5	100.0515	▲0.1917%	73.1581%	100.0532	▲0.1980%	10,528

●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)	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年以下)	1,500	2023/11/13			2,663	1,503	▲0.044		▲0.011	9.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/11/13			6,650	4,251	▲0.001		0.004	56.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/11/13			9,725	4,504	0.016		0.018	35.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/11/13			5,131	2,008	0.021		0.024	23.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/10	2023/11/13	▲0.350	41,452	41,452		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/10	2023/11/13	▲0.350	0	0				

●2023年11月13日の予定

*10月の企業物価指数	*10月の米財政収支
-------------	------------

◆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