

Central Daily Market Report

2023年11月8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8日 需給速報	2023年11月9日 需給予想	2023年11月10日 当社予想			
銀行券	600	▲ 100	▲ 400			
財政	300	200	▲ 9,000			
資金過不足	900	100	▲ 9,400			
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	6,600	▲ 7,100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入			▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 200				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 39,100	43,900	39,100			
当預増減	6,000	39,100	▲ 9,400			
当座預金残高	5,483,800	5,522,900	5,513,500			
準備預金残高	4,779,900					
積み終了先	4,779,300			11月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,779,300			積数	2,200	
非準備預金先	703,900			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	99.95%	日数	77.42%		

●2023年11月8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~▲0.15%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>

8日のアウトラ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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/11/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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			直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
単位: %									0.845	▲ 0.030	32,166.48	▲ 105.34	150.38-40	150.67-69
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.124						
T/N							-	▲ 0.164						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.018	▲ 0.026				-	▲ 0.167						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.168						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.173						
1M	▲ 0.005	0.250	0.165				-	▲ 0.179						
3M								▲ 0.204						
6M								▲ 0.167						
1Y								▲ 0.070						
日付		10/31	11/1	11/2	11/6	11/7								
日銀当預残	5,517,100	5,498,600	5,489,900	5,462,400	5,477,800									
準備預金残	4,803,400	4,794,300	4,779,700	4,772,000	4,775,200									
マネタリーベース	6,773,000	6,755,400	6,747,000	6,719,300	6,733,700									
無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.016%	▲ 0.011%	▲ 0.011%	▲ 0.010%									
コール市場残高	198,150	193,072	195,825	189,399	188,294									
うち無担	173,513	166,662	170,205	164,508	164,400									
うちO/N	107,111	97,295	102,948	96,571	95,413									
うち有担	24,637	26,410	25,620	24,891	23,894									

●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)		2023/11/8	2023/11/9	▲ 0.450	40,069	40,069		▲ 0.450	▲ 0.451	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/8	2023/11/9	▲ 0.450	2	2		▲ 0.450	▲ 0.450	

●2023年11月9日の予定

*決定会合における主な意見(10月30-31日分)	*国庫短期証券(1193回)入札(6ヶ月、40,000億円、11/10発行)	*30年利付国債入札(9,000億円、11/10発行)	*エネルギー対策借入(6,200億円、11/20借入)
*9月の国際収支			
*10月の景気ウォッチャー調査			

◆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