

Central Daily Market Report

2023年11月13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13日 需給速報	2023年11月14日 需給予想	2023年11月15日 当社予想			
銀行券	500	400	500			
財政	▲ 5,900	3,500	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 5,400	3,900	▲ 26,500			
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	12,100					
CP等買入		▲ 100	4,000	▲ 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						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 42,100	40,600	42,100			
*F/L資金供給用担保提供枠						
当預増減	5,100	49,900	▲ 26,500			
当座預金残高	5,474,600	5,524,500	5,498,000			
準備預金残高	4,771,500					
積み終了先	4,771,500			11月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,771,500			積数	0	
非準備預金先	703,100			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	93.55%		

●2023年11月13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▲0.015~▲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減退から、レート水準はやや上昇する展開となった。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、▲0.14~▲0.13%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>

13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、小口の案件が中心となるなか、一部業態から大型発行も実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/11/13	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		
	単位：%	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					-	▲ 0.146	0.870	0.020	32,585.11	17.00	151.46-48	151.73-75
T/N								-	▲ 0.128						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.036					-	▲ 0.150						
2W			▲ 0.020					-	▲ 0.157						
3W								-	▲ 0.167						
1M			▲ 0.015					-	▲ 0.173						
3M								▲ 0.235	▲ 0.193						
6M								▲ 0.170	▲ 0.121						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.083						
										日付	11/6	11/7	11/8	11/9	11/10
										日銀当預残	5,462,400	5,477,800	5,483,800	5,485,900	5,469,500
										準備預金残	4,772,000	4,775,200	4,779,900	4,783,100	4,760,900
										マネタリーベース	6,719,300	6,733,700	6,739,000	6,741,200	6,724,000
										無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.014%
										コール市場残高	189,399	188,294	198,219	197,823	209,313
										うち無担	164,508	164,400	172,523	171,636	185,264
										うちO/N	96,571	95,413	105,205	100,458	110,736
										うち有担	24,891	23,894	25,696	26,187	24,049

●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*	応募総額(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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/13	2023/11/14	▲ 0.350	42,977	42,977		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/13	2023/11/14	▲ 0.350	25	25		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2023年11月14日の予定

*5年利付国債入札 (25,000億円、11/15発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、11/22借入)	*10月の米消費者物価指数 *7-9月期のユーロ圏GDP2次速報
---------------------------------	----------------------------------	-------------------------------------

◆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ことがあります。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