

Central Daily Market Report

2023年11月14日(火)

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14日 需給速報	2023年11月15日 需給予想	2023年11月16日 当社予想			
銀行券	400	300	500			
財政	3,000	▲ 33,900	▲ 4,000			
資金過不足	3,400	▲ 33,600	▲ 3,500			
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	4,000	▲ 100	▲ 300			
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	▲ 36,100	42,100	36,100			
当預増減	13,300	2,200	▲ 3,500			
当座預金残高	5,487,900	5,490,100	5,486,600			
準備預金残高	4,790,500					
積み終了先	4,790,500			11月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,790,400			積数	0	
非準備預金先	697,400			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	96.77%		

●2023年11月14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▲0.008~▲0.010%程度での出会いとなった。積み最終日を明日に控え、ビッドサイドの調達ニーズは引き続き強く、レートは高水準で推移した。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~▲0.105%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>

14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

2023/11/14	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：%									0.850	▲ 0.020	32,695.93	110.82	151.61-64	151.63-65
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.117						
T/N							-	▲ 0.140						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.148						
2W	▲ 0.040	0.005	▲ 0.030				-	▲ 0.157						
3W			0.001				-	▲ 0.165						
1M	▲ 0.010	▲ 0.009	▲ 0.010				-	▲ 0.177						
3M								▲ 0.245						
6M								▲ 0.170						
1Y								▲ 0.070						
日付		11/7	11/8	11/9	11/10	11/13								
日銀当預残	5,477,800	5,483,800	5,485,900	5,469,500	5,474,600									
準備預金残	4,775,200	4,779,900	4,783,100	4,760,900	4,772,100									
マネタリーベース	6,733,700	6,739,000	6,741,200	6,724,000	6,728,500									
無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.014%	▲ 0.014%									
コール市場残高	188,294	198,219	197,823	209,313	184,122									
うち無担	164,400	172,523	171,636	185,264	159,364									
うちO/N	95,413	105,205	100,458	110,736	86,391									
うち有担	23,894	25,696	26,187	24,049	24,758									

●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1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	163	0.4%	25,000	2023/11/15	2028/9/20	84,488	20,282	99.90	0.421%	20.4239%	99.91	0.418%	4,703	10.5
交付税特会	-	-	13,000	2023/11/22	2024/5/22	490,055	12,990.15		0.000%	2.6508%		0.000%		10

●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
米ドル資金供給		2023/11/16	2023/11/24	5.580	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/14	2023/11/15	▲ 0.350	36,840	36,840		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/14	2023/11/15	▲ 0.350	112	112		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2023年11月15日の予定

*7-9月期のGDP1次速報 (市場予想：前年比年率▲0.6%)	*10月の米小売売上高 *10月の米生産者物価指数	*10月の英消費者物価指数 *9月の米企業在庫
-------------------------------------	------------------------------	----------------------------

◆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ようお願いします。
◆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