

Central Daily Market Report

2023年11月15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15日 需給速報	2023年11月16日 需給予想	2023年11月17日 当社予想			
銀行券	300	▲ 700	▲ 500			
財政	▲ 33,000	▲ 9,700	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 32,700	▲ 10,400	▲ 5,500			
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	100		▲ 100			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 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	▲ 38,000	36,100	38,000			
当預増減	▲ 34,800	40,200	▲ 5,500			
当座預金残高	5,453,100	5,493,300	5,487,800			
準備預金残高	4,762,900					
積み終了先	4,762,900			11月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,762,900			積数	3,891,200	
非準備預金先	690,200			1日平均	129,700	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,891,200	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2023年11月15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~▲0.005%程度での出会いとなった。積み最終日となったが、引き続きビッドサイドの調達ニーズが強く、レートは高水準での推移となった。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。

また本日は、短期金融市場、証券市場、外国為替市場の3市場合同で実施する業務継続計画に関する訓練の一環として、共通担保資金供給オペ(11月15日スタート、11月16日エンド、落札額52億円)が実施された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.16~▲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>

15日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/11/15	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				-	▲ 0.104	0.795	▲ 0.055	33,519.70	823.77	150.48-49	150.68-69
T/N							-	▲ 0.154						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.029	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.165						
2W	▲ 0.035	▲ 0.013	▲ 0.027				-	▲ 0.175						
3W							-	▲ 0.176						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.185						
3M							▲ 0.245	▲ 0.195						
6M							▲ 0.160	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.060	▲ 0.082						
									日付	11/8	11/9	11/10	11/13	11/14
									日銀当預残	5,483,800	5,485,900	5,469,500	5,474,600	5,487,900
									準備預金残	4,779,900	4,783,100	4,760,900	4,772,100	4,790,500
									マネタリーベース	6,739,000	6,741,200	6,724,000	6,728,500	6,741,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.012%
									コール市場残高	198,219	197,823	209,313	184,122	193,400
									うち無担	172,523	171,636	185,264	159,364	167,414
									うちO/N	105,205	100,458	110,736	86,391	93,731
									うち有担	25,696	26,187	24,049	24,758	25,986

●入札結果

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)	授分レート ・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	授分 比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2023/11/16			5,966	3,752	▲0.046		▲0.035	26.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/11/16			11,478	5,753	▲0.080		▲0.078	56.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/11/16			4,484	2,006	▲0.085		▲0.084	79.2
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/11/16			2,491	1,006	▲0.085		▲0.081	41.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/15	2023/11/16	▲0.350	38,847	38,847		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/15	2023/11/16	▲0.350	0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2023/11/15	2023/11/16	0.000	52	52				

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
被災地金融支援オペ	第22回	2023/11/17		0

●2023年11月16日の予定

*9月の機械受注統計 (市場予想: 船舶・電力除く民需、前月比+0.9%)	*10月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1195回)入札 (1年、35,000億円、11/20発行)
*10月の貿易統計		*流動性供給入札 (5,000億円、11/17発行)
*9月の第3次産業活動指数		*国有林野借入 (736億円、11/27借入)
*9月の石油等消費動態統計		

◆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