

Central Daily Market Report

2023年11月17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17日 需給速報	2023年11月20日 需給予想	2023年11月21日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 100	▲ 500			
財政	▲ 4,700	▲ 5,300	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 4,800	▲ 5,400	▲ 1,500			
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		▲ 200		▲ 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				▲ 500	1,000	
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 36,800	38,300		36,800		
当預増減	▲ 3,500	30,600		▲ 500		

●2023年11月17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。3日積み要因により、ビッドサイドの調達ニーズが強まり、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、▲0.13~▲0.11%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>

17日はTB3M物(第1196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は、強含みで推移した。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

当座預金残高	5,451,400	5,482,000	5,481,500	
準備預金残高	4,744,200			
積み終了先	4,733,600		11月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,592,100		積数	44,700
非準備預金先	707,200		1日平均	1,700
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	98.85%	日数	13.33%

●短期金融市場関連指標

2023/11/17	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	▲ 0.082	0.001	▲ 0.015					-	▲ 0.110	0.750	▲ 0.035	33,585.20	160.79	150.70-71	150.43-45
T/N								-	▲ 0.118						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.027					-	▲ 0.156						
2W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.017					-	▲ 0.169						
3W								-	▲ 0.175						
1M	▲ 0.020	0.090	▲ 0.009					-	▲ 0.183						
3M									▲ 0.270						
6M									▲ 0.160						
1Y									▲ 0.070						
										日付	11/10	11/13	11/14	11/15	11/16
										日銀当預残	5,469,500	5,474,600	5,487,900	5,453,100	5,454,900
										準備預金残	4,760,900	4,772,100	4,790,500	4,763,100	4,759,200
										マネタリーベース	6,724,000	6,728,500	6,741,400	6,706,300	6,708,800
										無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.012%	▲0.011%	▲0.027%
										コール市場残高	209,313	184,122	193,400	188,388	181,002
										うち無担	185,264	159,364	167,414	161,353	153,534
										うちO/N	110,736	86,391	93,731	91,030	86,651
										うち有担	24,049	24,758	25,986	27,035	27,468

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1196	-	56,000	2023/11/20	2024/2/26	160,659	45,471.7	100.0595	▲0.2214%	77.3439%	100.0626	▲0.2330%	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・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)		2023/11/17	2023/11/20	▲ 0.350	37,400	37,400		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/17	2023/11/20	▲ 0.350	0	0				

●2023年11月20日の予定

*特にありません

◆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