

Central Daily Market Report

2023年11月20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20日 需給速報	2023年11月21日 需給予想	2023年11月22日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 300	▲ 500			
財政	▲ 6,300	▲ 2,400	▲ 14,000			
資金過不足	▲ 6,500	▲ 2,700	▲ 14,500			
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						▲ 6,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 500	1,000			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 37,300	36,800		37,300		
当増減	▲ 7,800		35,500		▲ 21,100	
当座預金残高	5,443,600		5,479,100		5,458,000	
準備預金残高	4,746,900					
積み終了先	4,741,800				11月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,739,300				積数	37,100
非準備預金先	696,700				1日平均	1,500
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	99.05%		日数	16.67%	

●2023年11月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.015~▲0.008%近辺の出合いが始まった。週末要因が剥落したものの、引き続き資金調達ニーズが強く、レートは高水準での出合いが継続した。一巡後は、出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.115~▲0.105%程度での出合いとなった。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>

20日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/11/20	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.013					-	▲ 0.096	0.740	▲ 0.010	33,388.03	▲ 197.17	149.95-97	148.91-92
T/N								-	▲ 0.111						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.033					-	▲ 0.146						
2W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.021					-	▲ 0.161						
3W			0.005					-	▲ 0.170						
1M			▲ 0.020					-	▲ 0.183						
3M			0.025					▲ 0.270	▲ 0.195						
6M								▲ 0.160	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.080						
										日付	11/13	11/14	11/15	11/16	11/17
										日銀当預残	5,474,600	5,487,900	5,453,100	5,454,900	5,451,400
										準備預金残	4,772,100	4,790,500	4,763,100	4,759,200	4,744,200
										マネタリーベース	6,728,500	6,741,400	6,706,300	6,708,800	6,705,400
										無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.012%	▲0.011%	▲0.027%	▲0.015%
										コール市場残高	184,122	193,400	188,388	181,002	182,669
										うち無担	159,364	167,414	161,353	153,534	158,846
										うちO/N	86,391	93,731	91,030	86,651	90,343
										うち有担	24,758	25,986	27,035	27,468	23,823

●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I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)		2023/11/20	2023/11/21	▲ 0.350	37,716	37,716		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/20	2023/11/21	▲ 0.350	150	150		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2023年11月21日の予定

*10月の米中古住宅販売	*20年利付国債入札(12,000億円、11/22発行)	*交付税特別会計借入(13,000億円、11/30借入)
--------------	------------------------------	------------------------------

◆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