

# Central Daily Market Report

2023年11月21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21日 需給速報	2023年11月22日 需給予想	2023年11月24日 当社予想			
銀行券	▲ 400	▲ 1,400	▲ 1,000			
財政	▲ 3,300	▲ 12,000	5,000			
資金過不足	▲ 3,700	▲ 13,400	4,000			
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			6,400	▲ 6,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 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	1,000			▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 38,200	37,300		38,200		
当増減	▲ 3,700		25,200		4,000	
当座預金残高	5,439,900		5,465,100		5,469,100	
準備預金残高	4,737,200					
積み終了先	4,732,300			11月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,732,100			積数	32,000	
非準備預金先	702,700			1日平均	1,300	
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	99.18%		日数	20.00%	

## ●2023年11月21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▲0.013~▲0.005%近辺の出合いで始まった。引き続きビットサイドのニーズは強く、前日比でレートを引き上げて調達する先も見られたため、出合い水準は僅かに上昇した。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、▲0.11~▲0.095%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>

本日は短国買入オペが、1,000億円でオファーされた。先週は足許の需給環境を考慮してかオファーが見送られたため、11月7日以来のオファーとなったが、引き続き弱めの結果となった。マーケットで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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2023/11/21	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)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.094	0.694	▲ 0.046	33,354.14	▲ 33.89	148.38-40	147.50-53
T/N							-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.013				-	▲ 0.144						
2W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.162						
3W							-	▲ 0.169						
1M			0.011				-	▲ 0.183						
3M	0.025	0.150	0.027				▲ 0.270	▲ 0.194						
6M							▲ 0.160	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.080						
									日付	11/14	11/15	11/16	11/17	11/20
									日銀当預残	5,487,900	5,453,100	5,454,900	5,451,400	5,443,600
									準備預金残	4,790,500	4,763,100	4,759,200	4,744,200	4,746,900
									マネタリーベース	6,741,400	6,706,300	6,708,800	6,705,400	6,697,700
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.011%	▲0.027%	▲0.015%	▲0.013%
									コール市場残高	193,400	188,388	181,002	182,669	191,725
									うち無担	167,414	161,353	153,534	158,846	164,478
									うちO/N	93,731	91,030	86,651	90,343	93,915
									うち有担	25,986	27,035	27,468	23,823	27,247

## ●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
20年利付国債	186	1.5%	12,000	2023/11/22	2043/9/20	34,309	9,692	101.05	1.432%	8.6021%	101.19	1.423%	2,302	
交付税特会	-	-	13,000	2023/11/30	2024/5/29	471,253	12,990.27		0.000%	2.7566%		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
国庫短期証券買入	1,000	2023/11/22			6,157	1,000	0.012		0.013	90.0
米ドル資金供給		2023/11/24	2023/11/30	5.580	2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/21	2023/11/22	▲0.350	38,615	38,615		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/11/22	2023/12/6	0.000	6,360	6,360				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/21	2023/11/22	▲0.350	16	16		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/11/22	2023/12/1		2	2		▲0.100	▲0.100	

## ●2023年11月22日の予定

*月例経済報告	*10月の米耐久財新規受注
---------	---------------

◆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