

# Central Daily Market Report

2023年11月24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24日 需給速報	2023年11月27日 需給予想	2023年11月28日 当社予想
銀行券	200	▲ 300	▲ 500
財政	5,500	▲ 3,700	1,000
資金過不足	5,700	▲ 4,000	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	14,100					
CP等買入		▲ 400		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 800		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 42,700	38,900		42,700		
当増減	15,300		37,500		500	

当座預金残高	5,442,400	5,479,900	5,480,400	
準備預金残高	4,748,400			
積み終了先	4,746,200	11月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,746,200	積数	18,200	
非準備預金先	694,000	1日平均	1,000	
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	99.53%	日数	36.67%

## ●2023年11月24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~▲0.005%近辺の出合いが始まった。引き続きビッドサイドのニーズが強いなか、週末3日積み要因も相まってレート水準は高止まりとなった。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、▲0.10~▲0.09%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>

24日はTB3M物(第1197回)の入札が実施され、小じっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、無難に推移した。

### <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

2023/11/24	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	▲ 0.080	0.000	▲ 0.012					-	▲ 0.085	0.769	0.044	33,625.53	173.70	149.62-64	149.42-44
T/N								-	▲ 0.099						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.029					-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.012					-	▲ 0.147						
3W								-	▲ 0.159						
1M	▲ 0.003	0.015	0.011					-	▲ 0.172						
3M			0.025					▲ 0.222	▲ 0.194						
6M								▲ 0.160	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.080						
										日付	11/16	11/17	11/20	11/21	11/22
										日銀当預残	5,454,900	5,451,400	5,443,600	5,439,900	5,427,100
										準備預金残	4,759,200	4,744,200	4,746,900	4,737,200	4,729,200
										マネタリーベース	6,708,800	6,705,400	6,697,700	6,694,400	6,682,900
										無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.015%	▲0.013%	▲0.012%	▲0.012%
										コール市場残高	181,002	182,669	191,725	184,999	200,731
										うち無担	153,534	158,846	164,478	159,436	174,414
										うちO/N	86,651	90,343	93,915	86,583	100,371
										うち有担	27,468	23,823	27,247	25,563	26,317

## ●入札結果

名称	回数	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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1197	-	56,000	2023/11/27	2024/3/4	114,595	45,471.7	100.0550	▲0.2047%	46.3726%	100.0609	▲0.2266%	10,528	
流動性供給	394	-	5,000	2023/11/27	-	21,853	4,989		0.033%	14.4619%		0.031%		
交付税特会	-	-	13,000	2023/12/4	2024/5/31	486,239	12,990.07		0.000%	2.6716%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/24	2023/11/27	▲ 0.350	43,317	43,317		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/24	2023/11/27	▲ 0.350	0	0				

## ●2023年11月27日の予定

*10月の企業向けサービス価格指数	*10月の米新築一戸建て販売件数
-------------------	------------------

◆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