

Central Daily Market Report

2023年11月27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27日 需給速報	2023年11月28日 需給予想	2023年11月29日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 500	▲ 500			
財政	▲ 4,500	▲ 4,100	▲ 14,000			
資金過不足	▲ 4,700	▲ 4,600	▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
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		▲ 800				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 41,800	42,700		41,800		
当増減	▲ 5,000	36,800		▲ 14,500		
当座預金残高	5,437,400	5,474,200		5,459,700		
準備預金残高	4,757,500					
積み終了先	4,755,100				11月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,755,100				積数	15,800
非準備預金先	679,900				1日平均	900
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	99.59%		日数		40.00%

●2023年11月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.018~▲0.01%近辺での出会いとなった。
ターム物はショートターム物での出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%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>

27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発行市場は複数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。
また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.000%、平均落札レート+0.027%と、前回(按分▲0.003%、平均+0.004%)比で按分、平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2023/11/27	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.077	0.770	0.001	33,447.67	▲ 177.86	149.57-58	149.02-03	
T/N							-	▲ 0.097							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.131							
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.142							
3W							-	▲ 0.157							
1M							-	▲ 0.172							
3M			0.020				▲ 0.215	▲ 0.192							
6M							▲ 0.160	▲ 0.116							
1Y							▲ 0.065	▲ 0.078							
日付	11/17	11/20	11/21	11/22	11/24										
日銀当預残	5,451,400	5,443,600	5,439,900	5,427,100	5,442,400										
準備預金残	4,744,200	4,746,900	4,737,200	4,729,200	4,748,500										
マネタリーベース	6,705,400	6,697,700	6,694,400	6,682,900	6,698,100										
無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.013%	▲0.012%	▲0.012%	▲0.012%										
コール市場残高	182,669	191,725	184,999	200,731	192,440										
うち無担	158,846	164,478	159,436	174,414	165,727										
うちO/N	90,343	93,915	86,583	100,371	92,925										
うち有担	23,823	27,247	25,563	26,317	26,713										

●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
CP等買入	4,000	2023/11/30			7,186	3,986	0.000		0.027	50.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/27	2023/11/28	▲ 0.350	42,507	42,507		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/27	2023/11/28	▲ 0.350	0	0				

●2023年11月28日の予定

*9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

*40年利付国債入札
(7,000億円、11/29発行)

◆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