

Central Daily Market Report

2023年11月28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28日 需給速報	2023年11月29日 需給予想	2023年11月30日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 600	▲ 700			
財政	▲ 4,500	▲ 10,900	9,400			
資金過不足	▲ 5,000	▲ 11,500	8,700			
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			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 400	▲ 400	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 41,300	41,800		41,300		
当増減	▲ 4,900	30,400	12,700			
当座預金残高	5,432,500	5,462,900	5,475,600			
準備預金残高	4,744,900					
積み終了先	4,742,400			11月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,742,400			積数	13,300	
非準備預金先	687,600			1日平均	800	
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	99.66%	日数	43.33%		

●2023年11月28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▲0.025~▲0.012%近辺での出会いが始まった。今週に入り、レート水準は緩やかな低下傾向となる中、一巡後も同水準で散発的な出会いが見られた。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>

28日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱い結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、月末発行にあたり、複数の業態から発行が実施され、一部で大型の案件も見られた。発行レートに大きな変化はなく、横這い圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2023/11/28	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	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.021					-	▲ 0.087	0.750	▲ 0.020	33,408.39	▲ 39.28	148.40-42	148.51-53
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.026					-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.033	0.003	▲ 0.026					-	▲ 0.143						
3W								-	▲ 0.156						
1M			0.005					-	▲ 0.167						
3M								▲ 0.210	▲ 0.195						
6M								▲ 0.160	▲ 0.116						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.076						
日付		11/20	11/21	11/22	11/24	11/27									
日銀当預残		5,443,600	5,439,900	5,427,100	5,442,400	5,437,400									
準備預金残		4,746,900	4,737,200	4,729,200	4,748,500	4,757,600									
マネタリーベース		6,697,700	6,694,400	6,682,900	6,698,100	6,693,400									
無担O/N加重平均		▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.017%									
コール市場残高		191,725	184,999	200,731	192,440	195,426									
うち無担		164,478	159,436	174,414	165,727	168,196									
うちO/N		93,915	86,583	100,371	92,925	94,679									
うち有担		27,247	25,563	26,317	26,713	27,230									

●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非価格競争入札(億円)
40年利付国債	16	1.3%	7,000	2023/11/29	2063/3/20	15,444	6,996	85.70	1.810%	85.0649%			

●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	2023/11/29			8,733	1,000		0.021	0.021	
米ドル資金供給		2023/11/30	2023/12/7	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/28	2023/11/29	▲ 0.350	41,989	41,989		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/28	2023/11/29	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特別第38期(借り換え)	2023/12/4	2024/12/4	842	13
成長基盤強化	米ドル特別第34期(借り換え)	2023/12/4	2024/12/4	2,483	19

●2023年11月29日の予定

*愛媛県金融経済懇談会において安達日銀審議委員講演

*7-9月期の米GDP改定値

*11月の米CB消費者信頼感指数

*米ページブック

◆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