

Central Daily Market Report

2023年11月29日(水)

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29日 需給速報	2023年11月30日 需給予想	2023年12月1日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 800	▲ 1,500			
財政	▲ 11,600	6,200	▲ 24,000			
資金過不足	▲ 12,300	5,400	▲ 25,500			
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	1,000					
国債買入		12,400				
CP等買入		▲ 400	▲ 3,600			
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						
国債補充供給	▲ 40,500	41,300		40,500		
当預増減	▲ 10,900	58,700	▲ 25,500			
当座預金残高	5,421,600	5,480,300	5,454,800			
準備預金残高	4,726,200					
積み終了先	4,724,100			11月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,724,000			積数	11,100	
非準備預金先	695,400			1日平均	700	
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	99.71%	日数	46.67%		

●2023年11月29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、国内勢を中心に▲0.025~▲0.012%近辺での出会いとなった。一巡後も同水準の出会いが継続した。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、▲0.11~▲0.095%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>

29日のアウトライト市場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

2023/11/29	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	
	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.089	0.675	▲ 0.075	33,321.22	▲ 87.17	147.06-07	147.29-31
T/N							-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.019	▲ 0.024				-	▲ 0.129						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.143						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.154						
1M	▲ 0.010	0.010	▲ 0.002				-	▲ 0.167						
3M	0.015	0.030	0.021				▲ 0.210	▲ 0.194						
6M							▲ 0.160	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.076						
日付	11/21	11/22	11/24	11/27	11/28									
日銀当預残	5,439,900	5,427,100	5,442,400	5,437,400	5,432,500									
準備預金残	4,737,200	4,729,200	4,748,500	4,757,600	4,744,900									
マネタリーベース	6,694,400	6,682,900	6,698,100	6,693,400	6,689,000									
無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.017%	▲ 0.021%									
コール市場残高	184,999	200,731	192,440	195,426	204,715									
うち無担	159,436	174,414	165,727	168,196	176,111									
うちO/N	86,583	100,371	92,925	94,679	101,874									
うち有担	25,563	26,317	26,713	27,230	28,604									

●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1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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/11/30			12,132	4,504	▲0.041		▲0.039	22.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,250	2023/11/30			10,211	5,255	▲0.057		▲0.054	74.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/11/30			2,718	2,001	▲0.038		▲0.033	87.3
国債買入(物価連動債)	600	2023/11/30			2,893	600	▲0.510		▲0.518	33.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/29	2023/11/30	▲0.350	41,016	41,016		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/29	2023/11/30	▲0.350		0				

●2023年11月30日の予定

*兵庫県金融経済懇話会において中村日銀審議委員講演	*10月の米個人所得・消費支出(PCE)	*2年利付国債入札(29,000億円、12/1発行)
*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.8%)	*11月のシカゴPM景況感指数	
*10月の商業動態統計速報	*11月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*10月の住宅着工統計		
*11月の消費動向調査		

◆本資料は信頼できると思わ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