

# Central Daily Market Report

2023年11月30日(木)

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30日 需給速報	2023年12月1日 需給予想	2023年12月4日 当社予想			
銀行券	▲ 800	▲ 600	▲ 500			
財政	6,400	▲ 48,100	▲ 65,000			
資金過不足	5,600	▲ 48,700	▲ 65,500			
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	12,400					
CP等買入	4,000	▲ 3,600				
貸出支援基金(成)						▲ 10,300
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 39,900	40,500		39,900		
当増減	19,000	▲ 9,000		▲ 75,800		
当座預金残高	5,440,600	5,431,600		5,355,800		
準備預金残高	4,722,300					
積み終了先	4,720,200			12月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,720,200			積数	9,000	
非準備預金先	718,300			1日平均	600	
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	99.77%		日数	50.00%	

## ●2023年11月30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▲0.03~▲0.012%近辺での出会いとなった。レート水準は前日に比べやや低下したものの、概ね横這い圏での推移となり、一巡後も同水準での出会いが継続された。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、▲0.105~▲0.090%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>

30日のアウトライ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。

## ●短期金融市場関連指標

2023/11/30	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.091	0.670	▲ 0.005	33,486.89	165.67	147.05-06	147.05-07
T/N							-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.019	▲ 0.013	▲ 0.017				-	▲ 0.127						
2W	▲ 0.035	0.010	▲ 0.030				-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.152						
1M	▲ 0.028	▲ 0.023	▲ 0.026				-	▲ 0.178						
3M								▲ 0.165						
6M								▲ 0.160						
1Y								▲ 0.065						
日付		11/22	11/24	11/27	11/28	11/29								
日銀当預残		5,427,100	5,442,400	5,437,400	5,432,500	5,421,600								
準備預金残		4,729,200	4,748,500	4,757,600	4,744,900	4,726,300								
マネタリーベース		6,682,900	6,698,100	6,693,400	6,689,000	6,678,700								
無担O/N加重平均		▲0.012%	▲0.012%	▲0.017%	▲0.021%	▲0.022%								
コール市場残高		200,731	192,440	195,426	204,715	203,871								
うち無担		174,414	165,727	168,196	176,111	176,761								
うちO/N		100,371	92,925	94,679	101,874	101,784								
うち有担		26,317	26,713	27,230	28,604	27,110								

## ●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)
2年利付国債	455	0.005%	29,000	2023/12/1	2025/12/1	68,727	23,612	99.905	0.052%	65.5158%	99.917	0.046%	5,382

## ●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*	申込総額(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)		2023/11/30	2023/12/1	▲ 0.350	40,191	40,191		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/30	2023/12/1	▲ 0.350	0	0				

## ●2023年12月1日の予定

\*10月の完全失業率(市場予想:2.6%)  
\*10月の有効求人倍率(市場予想:1.29倍)  
\*7-9月期の法人企業統計調査季報

\*11月のISM製造業景況指数  
\*10月の米建設支出

\*国庫短期証券(1198回)入札  
(3ヶ月、56,000億円、12/4発行)  
\*交付税特別会計借入  
(13,000億円、12/8借入)

◆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