

# Central Daily Market Report

2023年11月22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22日 需給速報		2023年11月24日 需給予想		2023年11月27日 当社予想	
銀行券	▲ 1,300		100		500	
財政	▲ 11,200		7,000		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 12,500		7,100		▲ 2,500	
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	6,400	▲ 6,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			14,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 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		▲ 100		▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 38,900	38,200		38,900		
当増増減	▲ 12,800		59,400		▲ 2,500	
当座預金残高	5,427,100		5,486,500		5,484,000	
準備預金残高	4,728,800					
積み終了先	4,726,600		11月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,725,200		積数		25,000	
非準備預金先	698,300		1日平均		1,100	
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 99.36%		日数		26.67%	

## ●2023年11月22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~▲0.008%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は強く、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、▲0.11~▲0.10%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>

22日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

### <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

2023/11/22	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.092	0.725	0.031	33,451.83	97.69	148.13-15	148.95-97
T/N							-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.019	▲ 0.021				-	▲ 0.137						
2W	▲ 0.023	▲ 0.009	▲ 0.020				-	▲ 0.157						
3W							-	▲ 0.164						
1M			0.080				-	▲ 0.180						
3M			0.025				▲ 0.270	▲ 0.192						
6M							▲ 0.160	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.080						
									日付	11/15	11/16	11/17	11/20	11/21
									日銀当預残	5,453,100	5,454,900	5,451,400	5,443,600	5,439,900
									準備預金残	4,763,100	4,759,200	4,744,200	4,746,900	4,737,200
									マネタリーベース	6,706,300	6,708,800	6,705,400	6,697,700	6,694,400
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.027%	▲0.015%	▲0.013%	▲0.012%
									コール市場残高	188,388	181,002	182,669	191,725	184,999
									うち無担	161,353	153,534	158,846	164,478	159,436
									うちO/N	91,030	86,651	90,343	93,915	86,583
									うち有担	27,035	27,468	23,823	27,247	25,563

## ●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非償債競争入札(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1年超3年以下)	3,750	2023/11/24			9,668	3,759	0.008		0.010	56.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/11/24			13,481	4,501	0.014		0.019	0.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,250	2023/11/24			9,767	5,257	0.016		0.018	27.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2023/11/24			1,802	753	0.052		0.054	17.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/11/22	2023/11/24	▲0.350	39,301	39,301		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/11/22	2023/11/24	▲0.350				▲0.350	▲0.350	

## ●2023年11月23日の予定

*勤労感謝の日	*New York祝日(Thanksgiving Day)
---------	-------------------------------

## ●2023年11月24日の予定

*10月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.0%)	*国庫短期証券(1197回)入札 (3ヶ月、56,000億円、11/27発行)	*流動性供給入札 (5,000億円、11/27発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、12/4借入)
*9月の景気動向指数改訂状況			

◆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