

# Central Daily Market Report

2023年12月1日(金)  
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12月1日 需給速報	2023年12月4日 需給予想	2023年12月5日 当社予想			
銀行券	▲ 600	▲ 600	▲ 1,000			
財政	▲ 44,700	▲ 66,500	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 45,300	▲ 67,100	▲ 2,000			
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			▲ 200			
貸出支援基金(成)			▲ 9,100			
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	▲ 41,400	39,900	41,400			
当預増減	▲ 47,000	▲ 35,000	▲ 2,000			

## ●2023年12月1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～▲0.01%近辺での出会いとなった。週末3日積みとなった事で昨日までの低下基調から一転し、レートは上昇する展開となった。  
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、▲0.105～▲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>

1日はTB3M物(第1198回)の入札が実施され、前回債(第1197回)に比べ甘めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、横這い圏で推移した。

### <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。

当座預金残高	5,393,600	5,358,600	5,356,600	
準備預金残高	4,692,700			
積み終了先	4,691,700	12月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,691,400	積数	5,100	
非準備預金先	700,900	1日平均	400	
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	99.87%	日数	60.00%

## ●短期金融市場関連指標

2023/12/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲ 0.015				-	▲ 0.094	0.700	0.030	33,431.51	▲ 55.38	147.99-01	148.28-30
T/N							-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.036				-	▲ 0.124						
2W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.032				-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.183						
3M							▲ 0.165	▲ 0.183						
6M							▲ 0.160	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.076						
									日付	11/24	11/27	11/28	11/29	11/30
									日銀当預残	5,442,400	5,437,400	5,432,500	5,421,600	5,440,600
									準備預金残	4,748,500	4,757,600	4,744,900	4,726,300	4,722,300
									マネタリーベース	6,698,100	6,693,400	6,689,000	6,678,700	6,698,500
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.017%	▲0.021%	▲0.022%	▲0.022%
									コール市場残高	192,440	195,426	204,715	203,871	191,406
									うち無担	165,727	168,196	176,111	176,761	164,075
									うちO/N	92,925	94,679	101,874	101,784	92,233
									うち有担	26,713	27,230	28,604	27,110	27,331

## ●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1198	-	56,000	2023/12/4	2024/3/11	148,153	45,471.2	100.0405	▲0.1507%	13.8951%	100.0445	▲0.1656%	10,528	
交付税特会	-	-	13,000	2023/12/8	2024/6/4	489,661	12,990.65		0.000%	2.6530%		0.000%		10

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/1	2023/12/4	▲ 0.350	41,686	41,686		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/1	2023/12/4	▲ 0.350	68	68		▲0.350	▲0.350	

## ●2023年12月4日の予定

\*11月のマネタリーベース

\*10月の米製造業新規受注・出荷・在庫

\*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み

◆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