

# Central Daily Market Report

2023年12月4日(月)  
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4日 需給速報	2023年12月5日 需給予想	2023年12月6日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 900	▲ 1,000			
財政	▲ 68,100	1,800	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 68,600	900	▲ 28,000			
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						▲ 6,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		10,300				
CP等買入		▲ 200	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 43,500	41,400		43,500		
当預増減	▲ 80,000	54,500		▲ 34,400		
当座預金残高	5,313,600	5,368,100		5,333,700		
準備預金残高	4,629,600					
積み終了先	4,628,600			12月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,628,600			積数	4,100	
非準備預金先	684,000			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	99.89%		日数	63.33%	

## ●2023年12月4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。週末要因が剥落したものの、引き続き調達ニーズが強く、レートは横ばいからやや上昇と高めに推移した。  
ターム物は年内物のショートタームを中心に出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.085%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>

4日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

### <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

2023/12/4	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	売買参考統計値	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	▲ 0.013					-	▲ 0.085	0.690	▲ 0.010	33,231.27	▲ 200.24	146.35-38	146.95-97
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.030					-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.030	▲ 0.018	▲ 0.027					-	▲ 0.134						
3W								-	▲ 0.147						
1M								-	▲ 0.186						
3M								▲ 0.160	▲ 0.178						
6M								▲ 0.160	▲ 0.118						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.079						
日付		11/27	11/28	11/29	11/30	12/1									
日銀当預残		5,437,400	5,432,500	5,421,600	5,440,600	5,393,600									
準備預金残		4,757,600	4,744,900	4,726,300	4,722,300	4,697,600									
マネタリーベース		6,693,400	6,689,000	6,678,700	6,698,500	6,652,100									
無担O/N加重平均		▲ 0.017%	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.015%									
コール市場残高		195,426	204,715	203,871	191,406	198,485									
うち無担		168,196	176,111	176,761	164,075	169,737									
うちO/N		94,679	101,874	101,784	92,233	96,245									
うち有担		27,230	28,604	27,110	27,331	28,748									

## ●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1年超3年以下)	3,750	2023/12/5			9,880	3,751	▲0.005		▲0.004	55.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/12/5			9,753	4,506	▲0.014		▲0.012	7.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2023/12/5			2,603	1,505	0.012		0.013	91.1
国債買入(残存期間25年超)	750	2023/12/5			1,393	753	0.016		0.018	34.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/4	2023/12/5	▲0.350	43,900	43,900		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/4	2023/12/5	▲0.350	0	0				

## ●2023年12月5日の予定

*12月の日銀当座預金増減要因見込み	*11月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札(27,000億円、12/6発行)
*11月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.4%)		*交付税特別会計借入(13,000億円、12/15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