

Central Daily Market Report

2023年12月6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12月6日 需給速報	2023年12月7日 需給予想	2023年12月8日 当社予想			
銀行券	▲ 1,200	▲ 2,000	▲ 1,500			
財政	▲ 32,000	1,400	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 33,200	▲ 600	▲ 6,500			
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	6,300	▲ 6,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300	▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 37,700	40,900	37,700			
当増減	▲ 29,500	37,000	▲ 6,500			
当座預金残高	5,298,500	5,335,500	5,329,000			
準備預金残高	4,613,500					
積み終了先	4,613,000			12月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,613,000			積数	3,000	
非準備預金先	685,000			1日平均	300	
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	99.92%	日数	70.00%		

●2023年12月6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▲0.015~▲0.005%近辺での出会いとなった。引き続き邦銀業態を中心に調達ニーズが強く、レートは前日比で横ばいからやや上昇となった。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、▲0.095~▲0.09%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>

6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、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/12/6	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.086	0.645	▲ 0.020					
T/N							-	▲ 0.090							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.030	0.008	▲ 0.023				-	▲ 0.113							
2W			0.000				-	▲ 0.131							
3W							-	▲ 0.138							
1M							-	▲ 0.180							
3M			0.026				▲ 0.160	▲ 0.166							
6M							▲ 0.160	▲ 0.115							
1Y							▲ 0.065	▲ 0.077							
日付		11/29	11/30	12/1	12/4	12/5									
日銀当預残	5,421,600	5,440,600	5,393,600	5,313,600	5,328,000										
準備預金残	4,726,300	4,722,300	4,697,600	4,629,600	4,643,100										
マネタリーベース	6,678,700	6,698,500	6,652,100	6,572,500	6,588,000										
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.022%	▲0.015%	▲0.013%	▲0.011%										
コール市場残高	203,871	191,406	198,485	197,462	195,047										
うち無担	176,761	164,075	169,737	167,338	166,858										
うちO/N	101,784	92,233	96,245	92,086	91,276										
うち有担	27,110	27,331	28,748	30,124	28,189										

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/6	2023/12/7	▲ 0.350	38,015	38,015		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/6	2023/12/7	▲ 0.350	0	0				

●2023年12月7日の予定

*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*10月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1199回)入札(6ヶ月、40,000億円、12/11発行)
*10月の景気動向指数速報	*10月の米消費者信用残高	*30年利付国債入札(9,000億円、12/8発行)
	*7-9月期のユーロ圏GDP確報値	

◆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