

Central Daily Market Report

2023年12月7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12月7日 需給速報	2023年12月8日 需給予想	2023年12月11日 当社予想			
銀行券	▲ 2,000	▲ 1,500	▲ 3,000			
財政	2,500	▲ 600	▲ 7,000			
資金過不足	500	▲ 2,100	▲ 10,000			
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)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 37,800	37,700	37,800			
当増増減	300	35,400	▲ 10,000			
当座預金残高	5,298,800	5,334,200	5,324,200			
準備預金残高	4,623,200					
積み終了先	4,622,900			12月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,622,900			積数	2,700	
非準備預金先	675,600			1日平均	300	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額						3,895,300
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	73.33%		

●2023年12月7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~▲0.004%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いものの、上昇余地が限られるため、レートは概ね横這い圏での推移となった。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、▲0.09~▲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>

7日はTB6M物(第1199回)の入札が実施され、しっかりとした結果になった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート+0.001%、平均落札レート+0.005%と、前回(按分0.000%、平均+0.027%)比で按分は上昇し、平均は低下した。

●短期金融市場関連指標

2023/12/7	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.010					-	▲ 0.080	0.750	0.105	32,858.31	▲ 587.59	147.17-19	145.67-69
T/N			▲ 0.015					-	▲ 0.088						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.111						
2W								-	▲ 0.126						
3W			▲ 0.015					-	▲ 0.136						
1M								-	▲ 0.173						
3M								▲ 0.160	▲ 0.166						
6M								▲ 0.150	▲ 0.118						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.078						
日付		11/30	12/1	12/4	12/5	12/6									
日銀当預残	5,440,600	5,393,600	5,313,600	5,328,000	5,298,500										
準備預金残	4,722,300	4,697,600	4,629,600	4,643,100	4,613,500										
マネタリーベース	6,698,500	6,652,100	6,572,500	6,588,000	6,559,700										
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.015%	▲0.013%	▲0.011%	▲0.010%										
コール市場残高	191,406	198,485	197,462	195,047	193,677										
うち無担	164,075	169,737	167,338	166,858	166,008										
うちO/N	92,233	96,245	92,086	91,276	91,426										
うち有担	27,331	28,748	30,124	28,189	27,669										

●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	棄分率	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)
国庫短期証券	1199	-	40,000	2023/12/11	2024/6/10	104,828	33,490	100.064	▲0.1282%	86.9500%	100.070	▲0.1402%	6,510
30年利付国債	80	1.8%	9,000	2023/12/8	2053/9/20	19,126	7,311	102.35	1.681%	14.0000%	103.55	1.623%	1,688

●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
CP等買入	4,000	2023/12/12			9,295	3,985	0.001		0.005	81.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/7	2023/12/8	▲ 0.350	37,475	37,475		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/7	2023/12/8	▲ 0.350	546	546		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2023年12月8日の予定

*7-9月期のGDP 2次速報(市場予想:前期比年率▲2.0%)	*11月の米雇用統計	*国庫短期証券(1200回)入札
*10月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲3.0%)	*12月のミシガン大消費者信頼感指数速報	(3ヶ月、56,000億円、12/11発行)
*10月の毎月労働統計調査速報	*10月の国際収支	
*10月の特定サービス産業動態統計速報		
*11月の景気ウォッチャー調査		

◆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たい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