

Central Daily Market Report

2023年12月8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8日 需給速報	2023年12月11日 需給予想	2023年12月12日 当社予想			
銀行券	▲ 1,600	▲ 1,000	▲ 2,500			
財政	▲ 1,600	▲ 13,300	▲ 3,000			
資金過不足	▲ 3,200	▲ 14,300	▲ 5,500			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		14,800				
CP等買入		▲ 200				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 債等買入		▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 37,200	37,800		37,200		
当増増減	▲ 2,900	37,700	▲ 5,500			
当座預金残高	5,295,900	5,333,600	5,328,100			
準備預金残高	4,621,200					
積み終了先	4,621,000			12月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,620,900			積数	1,700	
非準備預金先	674,700			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	99.96%	日数	83.33%		

●2023年12月8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~▲0.003%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なか、本日は、3日積みとなった事で、一段とニーズが強まる展開となったものの、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、▲0.085~▲0.08%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>

8日はTB3M物(第1200回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりの推移となった。

<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。

●短期金融市場関連指標

2023/12/8	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					-	▲ 0.082	0.769	0.019	32,307.86	▲ 550.45	144.24-26	144.08-10
T/N								-	▲ 0.085						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	0.008	▲ 0.013					-	▲ 0.111						
2W			▲ 0.025					-	▲ 0.123						
3W			▲ 0.013					-	▲ 0.158						
1M	0.020	0.150	0.107					-	▲ 0.171						
3M								▲ 0.156	▲ 0.159						
6M								▲ 0.160	▲ 0.119						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.078						
										日付	12/1	12/4	12/5	12/6	12/7
										日銀当預残	5,393,600	5,313,600	5,328,000	5,298,500	5,298,800
										準備預金残	4,697,600	4,629,600	4,643,100	4,613,500	4,623,700
										マネタリーベース	6,652,100	6,572,500	6,588,000	6,559,700	6,562,000
										無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.013%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%
										コール市場残高	198,485	197,462	195,047	193,677	191,806
										うち無担	169,737	167,338	166,858	166,008	162,933
										うちO/N	96,245	92,086	91,276	91,426	88,411
										うち有担	28,748	30,124	28,189	27,669	28,873

●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	1200	-	56,000	2023/12/11	2024/3/18	121,912	45,471.5	100.0385	▲0.1433%	16.7339%	100.0418	▲0.1556%	10,528

●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	2023/12/11			5,898	3,750	0.007		0.012	18.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/12/11			10,512	4,505	0.031		0.034	18.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,250	2023/12/11			5,915	5,251	0.012		0.037	20.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2023/12/11			1,511	1,500	▲0.016		0.063	89.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/8	2023/12/11	▲0.350	37,703	37,703		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/8	2023/12/11	▲0.350	0	0				

●2023年12月11日の予定

*11月のマネーストック

*10-12月期の法人企業景気予測調査季報

◆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