

Central Daily Market Report

2023年12月12日(火)

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12日 需給速報	2023年12月13日 需給予想	2023年12月14日 当社予想			
銀行券	▲ 1,500	▲ 1,600	▲ 2,000			
財政	4,400	▲ 17,500	2,000			
資金過不足	2,900	▲ 19,100	0			
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	4,000	▲ 500	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 37,700	36,400	37,700			
当増減	5,100	18,400	0			
当座預金残高	5,302,100	5,320,500	5,320,500			
準備預金残高	4,671,200					
積み終了先	4,670,900			12月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,670,800			積数	600	
非準備預金先	630,900			1日平均	200	
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	99.98%	日数	90.00%		

●2023年12月12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。前日に比べ取り上がる先がわずかに増加したものの、レート水準に大きな変化はなく、一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。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>

12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、一部業態から大型発行が実施されたが、全体としては小口の案件が中心となった。発行レートについては目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/12/12	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
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.085	0.735	▲ 0.040	32,843.70	51.90	146.05-06	145.43-45	
T/N							-	▲ 0.086							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.025	▲ 0.013	▲ 0.023				-	▲ 0.107							
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.122							
3W							-	▲ 0.171							
1M							-	▲ 0.169							
3M							▲ 0.156	▲ 0.153							
6M							▲ 0.160	▲ 0.112							
1Y							▲ 0.065	▲ 0.076							
日付	12/5	12/6	12/7	12/8	12/11										
日銀当預残	5,328,000	5,298,500	5,298,800	5,295,900	5,297,000										
準備預金残	4,643,100	4,613,500	4,623,700	4,623,400	4,637,500										
マネタリーベース	6,588,000	6,559,700	6,562,000	6,560,600	6,562,800										
無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.011%										
コール市場残高	195,047	193,677	191,806	192,068	183,645										
うち無担	166,858	166,008	162,933	162,195	155,926										
うちO/N	91,276	91,426	88,411	87,013	80,149										
うち有担	28,189	27,669	28,873	29,873	27,719										

●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	163	0.4%	25,000	2023/12/13	2028/9/20	78,328	20,341	100.32	0.331%	26.5146%	100.35	0.325%	4,646	10.82
エネルギー対策	-	-	7,000	2023/12/20	2024/12/20	130,500	6,999.96		0.000%	6.0607%		0.000%		

●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
米ドル資金供給		2023/12/14	2023/12/21	5.580	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/12	2023/12/13	▲0.350	38,158	38,158		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/12	2023/12/13	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/12/13	2023/12/22		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2023年12月13日の予定

*12月調査の日銀短観(概要及び要旨)

*米FOMC(2日目)

*FRB 米経済見通し発表

*11月の米生産者物価指数

◆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