

Central Daily Market Report

2023年12月13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13日 需給速報	2023年12月14日 需給予想	2023年12月15日 当社予想
銀行券	▲ 1,600	▲ 2,600	▲ 1,000
財政	▲ 17,400	4,100	61,000
資金過不足	▲ 19,000	1,500	60,000

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			11,400			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					51,100	▲ 20,600
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 33,600	37,700		33,600		
当増増減	▲ 15,100		46,000		90,500	

当座預金残高	5,287,000	5,333,000	5,423,500	
準備預金残高	4,645,800			
積み終了先	4,645,500	12月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,645,400	積数	200	
非準備預金先	641,200	1日平均	100	
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	99.99%	日数	93.33%

●2023年12月13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。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、▲0.011~▲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>

13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発行市場は複数の業態から発行が実施され、大型発行も見られた。発行レートは一部目線が高くなっている銘柄も見受けられた。

●短期金融市場関連指標

2023/12/13	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.086	0.685	▲ 0.050	32,926.35	82.65	145.25-29	145.81-82
T/N								-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.023	0.008	▲ 0.016					-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.028	▲ 0.013	▲ 0.025					-	▲ 0.124						
3W								-	▲ 0.172						
1M								-	▲ 0.168						
3M			0.040					▲ 0.156	▲ 0.152						
6M								▲ 0.160	▲ 0.109						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.075						

日付	12/6	12/7	12/8	12/11	12/12
日銀当預残	5,298,500	5,298,800	5,295,900	5,297,000	5,302,100
準備預金残	4,613,500	4,623,700	4,623,400	4,637,500	4,671,600
マネタリーベース	6,559,700	6,562,000	6,560,600	6,562,800	6,569,300
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.010%
コール市場残高	193,677	191,806	192,068	183,645	181,734
うち無担	166,008	162,933	162,195	155,926	152,715
うちO/N	91,426	88,411	87,013	80,149	77,503
うち有担	27,669	28,873	29,873	27,719	29,019

●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)
今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年以下)	1,500	2023/12/14			2,480	1,500	▲0.050		▲0.018	5.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2023/12/14			10,840	3,759	▲0.012		▲0.010	94.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,250	2023/12/14			12,350	5,255	▲0.036		▲0.034	89.0
国債買入(残存期間25年超)	750	2023/12/14			2,114	751	▲0.046		▲0.038	41.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/13	2023/12/14	▲0.350	33,688	33,688		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/13	2023/12/14	▲0.350	433	433		▲0.350	▲0.357	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2023/12/15	2027/12/15	0	51,094

●2023年12月14日の予定

*10月の機械受注統計 (市場予想: 船舶、電力除く民需、前月比▲0.5%)	*ECB理事会 *英中銀MPC *11月の米小売売上高 *10月の米企業在庫	*20年利付国債入札 (12,000億円、12/15発行)
---	---	----------------------------------

◆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