

Central Daily Market Report

2023年12月14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14日 需給速報	2023年12月15日 需給予想	2023年12月18日 当社予想			
銀行券	▲ 2,600	▲ 1,200	▲ 2,000			
財政	4,400	68,000	▲ 1,000			
資金過不足	1,800	66,800	▲ 3,000			
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		▲ 300		▲ 1,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			51,100	▲ 22,700		
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 34,800	33,600		34,800		
当増減	11,500		128,600		▲ 3,000	
当座預金残高	5,298,500		5,427,100		5,424,100	
準備預金残高	4,629,500					
積み終了先	4,629,500				12月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,629,400				積数	100
非準備預金先	669,000				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	100.00%			日数	96.67%

●2023年12月14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▲0.010~▲0.005%近辺での出会いとなった。積み期終盤となり、レートを切り上げて調達する先が複数見られた。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、▲0.15~▲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>

14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市場は、入札案件が少なく閑散な中、発行レートの目線に大きな変更は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/12/14	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.008					-	▲ 0.101	0.670	▲ 0.015	32,686.25	▲ 240.10	142.78-80	142.00-02
T/N								-	▲ 0.117						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.008	▲ 0.019					-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.025	▲ 0.008	▲ 0.020					-	▲ 0.149						
3W								-	▲ 0.185						
1M								-	▲ 0.181						
3M								▲ 0.156	▲ 0.152						
6M								▲ 0.160	▲ 0.108						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.076						
										日付	12/7	12/8	12/11	12/12	12/13
										日銀当預残	5,298,800	5,295,900	5,297,000	5,302,100	5,287,000
										準備預金残	4,623,700	4,623,400	4,637,500	4,671,600	4,646,500
										マネタリーベース	6,562,000	6,560,600	6,562,800	6,569,300	6,555,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.009%
										コール市場残高	191,806	192,068	183,645	181,734	179,724
										うち無担	162,933	162,195	155,926	152,715	148,919
										うちO/N	88,411	87,013	80,149	77,503	73,157
										うち有担	28,873	29,873	27,719	29,019	30,805

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非償額競争入札(億円)
20年利付国債	186	1.5%	12,000	2023/12/15	2043/9/20	25,198	9,752	100.50	1.467%	36.0220%	101.32	1.414%	2,244

●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
社債等買入	1,000	2023/12/19			1,810	1,000	0.340		0.375	95.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/14	2023/12/15	▲ 0.350	35,122	35,122		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/14	2023/12/15	▲ 0.350	0	0				

●2023年12月15日の予定

*10月の第3次産業活動指数	*11月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1201回)入札(3ヶ月、56,000億円、12/18発行)
*10月の石油等消費動態統計		

◆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