

Central Daily Market Report

2023年12月15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15日 需給速報	2023年12月18日 需給予想	2023年12月19日 当社予想			
銀行券	▲ 1,200	▲ 1,500	▲ 3,000			
財政	69,500	▲ 200	2,000			
資金過不足	68,300	▲ 1,700	▲ 1,000			
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						▲ 6,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 1,300		▲ 100		
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		▲ 100			1,000	
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 41,500	34,800		41,500		
当増減	88,600	39,700		▲ 6,300		
当座預金残高	5,387,100	5,426,800		5,420,500		
準備預金残高	4,688,300					
積み終了先	4,688,300			12月18日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,688,200			積数	108,300	
非準備預金先	698,800			1日平均	3,700	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,969,100	
準備預金進捗率	実績	97.27%		日数	6.45%	

●2023年12月15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。新しい積み期を跨ぐ取引となった事から、ビッドサイドの一部には調達量を制限する動きも見られたが、一般的には引き続き調達ニーズが強く、レートは高止まりした状態で今積み期を終えた。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、▲0.13~▲0.10%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>

15日はTB3M物(第1201回)の入札が実施され、強い結果となった。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、一部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

2023/12/15	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	
	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.132	0.705	0.035	32,970.55	284.30	142.27-30	141.96-99
T/N							-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.018	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.146						
2W	▲ 0.028	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.184						
3W							-	▲ 0.185						
1M	0.050	0.150	0.083				-	▲ 0.171						
3M								▲ 0.185						
6M								▲ 0.160						
1Y								▲ 0.060						
日付	12/8	12/11	12/12	12/13	12/14									
日銀当預残	5,295,900	5,297,000	5,302,100	5,287,000	5,298,500									
準備預金残	4,623,400	4,637,500	4,671,600	4,646,500	4,629,500									
マネタリーベース	6,560,600	6,562,800	6,569,300	6,555,900	6,570,000									
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.008%									
コール市場残高	192,068	183,645	181,734	179,724	178,973									
うち無担	162,195	155,926	152,715	148,919	149,726									
うちO/N	87,013	80,149	77,503	73,157	75,064									
うち有担	29,873	27,719	29,019	30,805	29,247									

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1201	-	56,000	2023/12/18	2024/3/25	140,019.1	45,471.6	100.0435	▲0.1619%	44.8368%	100.0463	▲0.1723%	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	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/15	2023/12/18	▲ 0.350	41,913	41,913		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/15	2023/12/18	▲ 0.350	0	0				

●2023年12月18日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、19日まで)

*国庫短期証券(1202回)入札
(1年、35,000億円、12/20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