

Central Daily Market Report

2023年12月18日(月)

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18日 需給速報	2023年12月19日 需給予想	2023年12月20日 当社予想			
銀行券	▲ 1,500	▲ 2,000	▲ 4,000			
財政	600	600	52,000			
資金過不足	▲ 900	▲ 1,400	48,000			
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			12,600	▲ 6,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			15,100			
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			1,000			
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 42,100	41,500		42,100		
当増減	▲ 1,600	63,100	48,000			
当座預金残高	5,385,500	5,448,600	5,496,600			
準備預金残高	4,688,700					
積み終了先	4,661,400			12月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,641,600			積数	61,200	
非準備預金先	696,800			1日平均	2,200	
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	98.46%	日数	9.68%		

●2023年12月18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~▲0.010%近辺での出会いとなった。積み初日の取引となり、レート水準は前営業日に比べやや低下したものの、引き続きビッドサイドの調達ニーズが強い展開となった。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、▲0.20~▲0.13%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>

18日はTB1Y物(第1202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、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施され、一部の業態で大型発行も見られた。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

2023/12/18	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	▲ 0.013					-	▲ 0.097	0.665	▲ 0.040	32,758.98	▲ 211.57	142.31-33	142.38-40
T/N								-	▲ 0.148						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.024					-	▲ 0.156						
2W								-	▲ 0.228						
3W								-	▲ 0.197						
1M								-	▲ 0.188						
3M								▲ 0.185	▲ 0.151						
6M								▲ 0.160	▲ 0.111						
1Y								▲ 0.010	▲ 0.071						
										日付	12/11	12/12	12/13	12/14	12/15
										日銀当預残	5,297,000	5,302,100	5,287,000	5,298,500	5,387,100
										準備預金残	4,637,500	4,671,600	4,646,500	4,629,500	4,688,500
										マネタリーベース	6,562,800	6,569,300	6,555,900	6,570,000	6,659,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.008%	▲ 0.009%
										コール市場残高	183,645	181,734	179,724	178,973	177,847
										うち無担	155,926	152,715	148,919	149,726	151,977
										うちO/N	80,149	77,503	73,157	75,064	77,965
										うち有担	27,719	29,019	30,805	29,247	25,870

●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	1202	-	35,000	2023/12/20	2024/12/20	105,855	29,794.5	100,000	0.0000%	95.8863%	100.004	▲0.0039%	5,205

●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	2023/12/19			6,672	3,752	0.001		0.004	50.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/12/19			10,337	4,501	0.001		0.006	78.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,250	2023/12/19			8,626	5,252	▲0.023		▲0.012	47.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2023/12/19			4,920	1,502	0.003		0.007	60.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/18	2023/12/19	▲0.350	42,601	42,601		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)・固定金利・金額無制限		2023/12/19	2024/1/10	0.000	12,622	12,622				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/18	2023/12/19	▲0.350	80	80		▲0.350	▲0.353	

●2023年12月19日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*11月の米住宅着工件数
*日銀総裁定例会見	*11月のユーロ圏消費者物価指数改定値
*月例経済報告	

◆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