

Central Daily Market Report

2023年12月19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19日 需給速報	2023年12月20日 需給予想	2023年12月21日 当社予想			
銀行券	▲ 2,100	▲ 2,400	▲ 2,000			
財政	▲ 800	48,300	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 2,900	45,900	▲ 7,000			
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			▲ 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	1,000		▲ 2,100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 44,400	42,100	44,400			
当増減	17,200	88,000	▲ 7,000			

当座預金残高	5,402,700	5,490,700	5,483,700	
準備預金残高	4,706,700			
積み終了先	4,693,100	12月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,690,200	積数	44,700	
非準備預金先	696,000	1日平均	1,700	
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	98.87%	日数	12.90%

●短期金融市場関連指標

2023/12/19	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	▲ 0.010				-	▲ 0.207	0.639	▲ 0.026	33,219.39	460.41	142.65-68	144.16-18
T/N			▲ 0.009				-	▲ 0.169						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.168						
2W							-	▲ 0.241						
3W							-	▲ 0.207						
1M							-	▲ 0.189						
3M							▲ 0.185	▲ 0.147						
6M							▲ 0.160	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.020	▲ 0.067						
日付	12/12	12/13	12/14	12/15	12/18									
日銀当預残	5,302,100	5,287,000	5,298,500	5,387,100	5,385,500									
準備預金残	4,671,600	4,646,500	4,629,500	4,688,500	4,688,600									
マネタリーベース	6,569,300	6,555,900	6,570,000	6,659,900	6,659,700									
無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.008%	▲ 0.009%	▲ 0.013%									
コール市場残高	181,734	179,724	178,973	177,847	189,000									
うち無担	152,715	148,919	149,726	151,977	162,806									
うちO/N	77,503	73,157	75,064	77,965	84,914									
うち有担	29,019	30,805	29,247	25,870	26,194									

●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		2023/12/21	2023/12/28	5.580	2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/19	2023/12/20	▲ 0.350	44,726	44,726		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/19	2023/12/20	▲ 0.350	0	0				

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について
1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。 (1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール) ①次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする(全員一致)。 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。 ②長短金利操作の運用(全員一致) 長期金利の上限は1.0%を目途とし、上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーブの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペ、共通担保資金供給オペなどを実施する。 (2) 資産買入れ方針(全員一致) 長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。 ①ETFおよびJ-R E I Tについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。 ②CP等は、約2兆円の残高を維持する。社債等は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(約3兆円)へと徐々に戻していく。ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。

◆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

●2023年12月19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。積み序盤の取引ではあるものの、ビッドサイドの調達ニーズは引き続き強く、レート水準は上昇した。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。

また、18日から19日に開催された日銀金融政策決定会合では、現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.14%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>

19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、数件の入札が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●入札結果

本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。

●2023年12月20日の予定

*7-9月期の資金循環統計速報 *11月の米中古住宅販売
*11月の貿易統計 *11月の英消費者物価指数
*流動性供給入札(5,000億円、12/21発行)