

Central Daily Market Report

2023年12月20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20日 需給速報	2023年12月21日 需給予想	2023年12月22日 当社予想			
銀行券	▲ 2,400	▲ 3,000	▲ 4,000			
財政	47,200	▲ 400	1,000			
資金過不足	44,800	▲ 3,400	▲ 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						
CP等買入		▲ 200		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 2,100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 42,900	44,400		42,900		
当増減	44,000	39,000		▲ 3,000		
当座預金残高	5,446,700	5,485,700		5,482,700		
準備預金残高	4,747,600					
積み終了先	4,740,000			12月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,737,300			積数	34,400	
非準備預金先	699,100			1日平均	1,300	
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	99.13%		日数	16.13%	

●2023年12月20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。引き続きビッドサイドの調達ニーズが強く、レート水準は高止まりした。一巡後はやや低めの出会いも散見された。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、▲0.20~▲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>

20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

2023/12/20	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	▲ 0.010					-	▲ 0.205	0.555	▲ 0.084	33,675.94	456.55	143.90-93	143.54-56
T/N			▲ 0.009					-	▲ 0.162						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.030	0.030	▲ 0.015					-	▲ 0.167						
2W	▲ 0.020	0.010	▲ 0.007					-	▲ 0.245						
3W			0.010					-	▲ 0.206						
1M								-	▲ 0.196						
3M			0.025					▲ 0.185	▲ 0.147						
6M								▲ 0.160	▲ 0.112						
1Y								▲ 0.030	▲ 0.067						
										日付	12/13	12/14	12/15	12/18	12/19
										日銀当預残	5,287,000	5,298,500	5,387,100	5,385,500	5,402,700
										準備預金残	4,646,500	4,629,500	4,688,500	4,688,600	4,706,700
										マネタリーベース	6,555,900	6,570,000	6,659,900	6,659,700	6,679,100
										無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.008%	▲0.009%	▲0.013%	▲0.010%
										コール市場残高	179,724	178,973	177,847	189,000	192,992
										うち無担	148,919	149,726	151,977	162,806	169,573
										うちO/N	73,157	75,064	77,965	84,914	89,411
										うち有担	30,805	29,247	25,870	26,194	23,419

●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)
流動性供給	395	-	5,000	2023/12/21	-	20,776	4,996		▲0.079%	77.5612%		▲0.081%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/20	2023/12/21	▲ 0.450	42,098	42,098		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/20	2023/12/21	▲ 0.450	1,193	1,193		▲0.450	▲0.450	

●2023年12月21日の予定

- *7-9月期の米GDP確報値
- *12月の米CB消費者信頼感指数

◆本資料は信頼できると思わ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