

# Central Daily Market Report

2023年12月21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21日 需給速報	2023年12月22日 需給予想	2023年12月25日 当社予想			
銀行券	▲ 3,000	▲ 2,800	▲ 2,000			
財政	▲ 1,800	5,500	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 4,800	2,700	▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 700		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 35,800	42,900		35,800		
当増減	1,800	37,400		▲ 7,000		
当座預金残高	5,448,500	5,485,900		5,478,900		
準備預金残高	4,738,600					
積み終了先	4,735,200			12月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,733,500			積数	29,200	
非準備預金先	709,900			1日平均	1,200	
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	99.26%		日数	19.35%	

## ●2023年12月21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。前日に比べ大きな変化はなく、引き続き調達ニーズの強さを反映し、レート水準は高止まりした。また一巡後は、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、▲0.15~▲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>

21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、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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

2023/12/21	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	▲ 0.011				-	▲ 0.097	0.585	0.030	33,140.47	▲ 535.47	143.52-54	143.25-27
T/N	▲ 0.020	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.129						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.008	▲ 0.016				-	▲ 0.153						
2W							-	▲ 0.245						
3W			0.030				-	▲ 0.204						
1M							-	▲ 0.194						
3M	0.026	0.040	0.029				▲ 0.185	▲ 0.152						
6M							▲ 0.160	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.067						
									日付	12/14	12/15	12/18	12/19	12/20
									日銀当預残	5,298,500	5,387,100	5,385,500	5,402,700	5,446,700
									準備預金残	4,629,500	4,688,500	4,688,600	4,706,700	4,744,300
									マネタリーベース	6,570,000	6,659,900	6,659,700	6,679,100	6,725,400
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.009%	▲0.013%	▲0.010%	▲0.010%
									コール市場残高	178,973	177,847	189,000	192,992	200,963
									うち無担	149,726	151,977	162,806	169,573	177,945
									うちO/N	75,064	77,965	84,914	89,411	91,263
									うち有担	29,247	25,870	26,194	23,419	23,018

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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。													

## ●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)		2023/12/21	2023/12/22	▲ 0.450	35,923	35,923		▲ 0.450	▲ 0.451	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/21	2023/12/22	▲ 0.450	0	0				

## ●2023年12月22日の予定

*11月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.5%)	*11月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1203回)入札 (3ヶ月、56,000億円、12/25発行)
*金融政策決定会合議事要旨(10月30・31日分)	*11月の米新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札 (5,000億円、12/25発行)
	*11月の米耐久財新規受注	
	*7-9月期の英GDP確報値	

◆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