

Central Daily Market Report

2023年12月22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22日 需給速報	2023年12月25日 需給予想	2023年12月26日 当社予想
銀行券	▲ 2,700	▲ 2,500	▲ 3,000
財政	3,800	7,000	2,000
資金過不足	1,100	4,500	▲ 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	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		▲ 400		▲ 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		▲ 100				
気候変動対応オペ								
E T F 買入								
国債補完供給	▲ 35,700	35,800		35,700				
当増減	100		39,700		▲ 1,000			

当座預金残高	5,448,600	5,488,300	5,487,300	
準備預金残高	4,729,600			
積み終了先	4,727,400		12月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,726,800		積数	21,000
非準備預金先	719,000		1日平均	1,000
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	99.47%	日数	29.03%

●2023年12月22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。引き続きビッドサイドの調達ニーズが強いなか、週末3日積みとなった事でレートを引き上げる先も散見された。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、▲0.125~▲0.09%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>

22日はTB3M物(第1203回)の入札が実施され、強い結果となったものの、結果発表後のセカンダリーでは、やや小甘い推移となった。

<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

2023/12/22	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.104	0.625	0.040	33,169.05	28.58	142.05-08	142.23-25
T/N			▲ 0.008				-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.024	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.261						
2W							-	▲ 0.234						
3W							-	▲ 0.201						
1M							-	▲ 0.193						
3M							▲ 0.220	▲ 0.156						
6M							▲ 0.160	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.067						
日付	12/15	12/18	12/19	12/20	12/21									
日銀当預残	5,387,100	5,385,500	5,402,700	5,446,700	5,448,500									
準備預金残	4,688,500	4,688,600	4,706,700	4,744,300	4,739,200									
マネタリーベース	6,659,900	6,659,700	6,679,100	6,725,400	6,730,200									
無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.013%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.011%									
コール市場残高	177,847	189,000	192,992	200,963	203,629									
うち無担	151,977	162,806	169,573	177,945	178,269									
うちO/N	77,965	84,914	89,411	91,263	87,647									
うち有担	25,870	26,194	23,419	23,018	25,360									

●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	乗分率	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	1203	-	56,000	2023/12/25	2024/4/4	106,497.1	45,474.8	100.0540	▲0.1950%	33.6530%	100.0663	▲0.2394%	10,525
流動性供給	396	-	5,000	2023/12/25	-	10,499	4,995		0.085%	68.7500%		0.064%	

●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)		2023/12/22	2023/12/25	▲ 0.350	35,938	35,938		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/22	2023/12/25	▲ 0.350	0	0				

●2023年12月25日の予定

*日本経済団体連合会審議委員会において植田日銀総裁講演
*10月の景気動向指数改訂状況

*New York、EURO、London祝日
(Christmas Day)

◆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