

Central Daily Market Report

2023年12月26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26日 需給速報	2023年12月27日 需給予想	2023年12月28日 当社予想			
銀行券	▲ 2,400	▲ 2,100	▲ 3,000			
財政	▲ 2,000	▲ 2,600	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 4,400	▲ 4,700	▲ 4,000			
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			1,000			
国債買入	12,200					
CP等買入		▲ 700	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 41,900	35,700	41,900			
当増減	900	37,800	▲ 4,000			
当座預金残高	5,454,100	5,491,900	5,487,900			
準備預金残高	4,741,800					
積み終了先	4,740,400			12月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,740,300			積数	17,900	
非準備預金先	712,300			1日平均	900	
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	99.55%	日数	35.48%		

●2023年12月26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。依然として資金調達ニーズが強く、前日比概ね横ばい圏で推移するなか、一巡後はビッドサイドの一部にレートを引き下げる動きが見られたため、▲0.01%台での出会いが中心となった。ターム物に関しては、四半期末を跨ぐ取引を見合わせる先も多く、閑散とした状況となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲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>

26日は短国買入オペが前回(12/5)と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットで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。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート+0.005%、平均落札レート+0.023%と、前回(按分+0.001、平均+0.005%)比で按分、平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2023/12/26	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	▲ 0.011					-	▲ 0.103	0.629	0.019	33,305.85	51.82	142.23-25	142.32-34
T/N	▲ 0.008	▲ 0.007	▲ 0.008					-	▲ 0.110						
S/N								-	-						
1W				0.070				-	▲ 0.227						
2W	▲ 0.020	0.020	▲ 0.016					-	▲ 0.197						
3W								-	▲ 0.187						
1M				0.015				-	▲ 0.175						
3M								▲ 0.220	▲ 0.155						
6M								▲ 0.160	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.050	▲ 0.066						
日付		12/19	12/20	12/21	12/22	12/25									
日銀当預残		5,402,700	5,446,700	5,448,500	5,448,600	5,453,200									
準備預金残		4,706,700	4,744,300	4,739,200	4,729,700	4,744,000									
マネタリーベース		6,679,100	6,725,400	6,730,200	6,733,100	6,740,100									
無担O/N加重平均		▲0.010%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.011%									
コール市場残高		192,992	200,963	203,629	211,411	202,992									
うち無担		169,573	177,945	178,269	186,881	175,618									
うちO/N		89,411	91,263	87,647	95,159	82,646									
うち有担		23,419	23,018	25,360	24,530	27,374									

●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	棄分率	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)
2年利付国債	456	0.1%	29,000	2024/1/4	2026/1/1	78,642	23,545	100.050	0.074%	69.2086%	100.071	0.064%	5,449

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/12/27			5,604	1,000	0.012		0.020	11.8
米ドル資金供給		2023/12/28	2024/1/11	5.580	0	0				
CP等買入	4,000	2023/12/29			7,600	3,990	0.005		0.023	92.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/26	2023/12/27	▲0.350	42,135	42,135		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/26	2023/12/27	▲0.350	0	0				

●2023年12月27日の予定

*決定会合における主な意見(12月18・19日分)
*11月の住宅着工統計

◆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