

Central Daily Market Report

2023年12月29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29日 需給速報	2024年1月4日 需給予想	2024年1月5日 当社予想
銀行券	300	2,300	3,000
財政	▲ 9,700	▲ 10,800	▲ 5,000
資金過不足	▲ 9,400	▲ 8,500	▲ 2,000

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	4,000	▲ 2,900				
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	▲ 41,800	46,000		41,800		
当増減	▲ 4,100		33,300		▲ 2,000	

当座預金残高	5,436,800	5,470,100	5,468,100	
準備預金残高	4,734,900			
積み終了先	4,734,100	1月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,732,900	積数	2,700	
非準備預金先	701,900	1日平均	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	99.93%	日数	61.29%

●2023年12月29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▲0.065~▲0.015%近辺と、ワイドレンジでの出会いとなった。年末を跨ぐ取引となり、調達を控える先が見られたことから、出会い水準は大幅に低下する展開となった。ターム物は年明けスタートのショートタームで出会いが散見された。

<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>

29日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<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

2023/12/29	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	▲ 0.039					-	▲ 0.087	0.615	0.031	33,464.17	▲ 75.45	141.43-45	141.39-41
T/N			▲ 0.038					-	▲ 0.108						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.032	▲ 0.010	▲ 0.024					-	▲ 0.136						
2W								-	▲ 0.140						
3W								-	▲ 0.144						
1M	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.015					-	▲ 0.146						
3M								▲ 0.210	▲ 0.147						
6M								▲ 0.160	▲ 0.097						
1Y								▲ 0.050	▲ 0.063						
										日付	12/22	12/25	12/26	12/27	12/28
										日銀当預残	5,448,600	5,453,200	5,454,100	5,449,700	5,440,900
										準備預金残	4,729,700	4,744,000	4,741,400	4,733,800	4,709,100
										マネタリーベース	6,733,100	6,740,100	6,743,400	6,741,000	6,734,900
										無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.013%	▲0.016%
										コール市場残高	211,411	202,992	204,971	205,902	202,268
										うち無担	186,881	175,618	179,081	179,163	174,810
										うちO/N	95,159	82,646	86,104	86,026	83,923
										うち有担	24,530	27,374	25,890	26,739	27,458

●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)		2023/12/29	2024/1/4	▲ 0.350	41,990	41,990		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/29	2024/1/4	▲ 0.350	0	0				

●2024年1月3日の予定

- *11月の米建設支出
- *12月のISM製造業景況指数

●2024年1月4日の予定

- *証券取引所大発会

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願い申し上げます。

◆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