

Central Daily Market Report

2023年12月5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5日 需給速報	2023年12月6日 需給予想	2023年12月7日 当社予想			
銀行券	▲ 1,000	▲ 1,200	▲ 2,000			
財政	2,700	▲ 32,400	1,000			
資金過不足	1,700	▲ 33,600	▲ 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
貸出						
全店共通			6,300	▲ 6,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	10,300					
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 債等買入				▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 40,900	43,500		40,900		
当預増減	14,400	7,800	▲ 1,000			
当座預金残高	5,328,000	5,335,800	5,334,800			
準備預金残高	4,642,800					
積み終了先	4,642,400			12月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,642,100			積数	3,400	
非準備預金先	685,200			1日平均	300	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,891,200	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	66.67%		

●2023年12月5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。前日の税揚げ要因もあり、引き続き邦銀業態を中心に調達ニーズが強く、レートは前日比でやや上昇した。ターム物は期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、▲0.095~▲0.08%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>

5日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや強めの結果となった。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、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

2023/12/5	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.011				-	▲ 0.077	0.665	▲ 0.025	32,775.82	▲ 455.45	147.28-30	146.83-85
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.115						
2W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.131						
3W	▲ 0.023	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.142						
1M							-	▲ 0.177						
3M							▲ 0.160	▲ 0.173						
6M							▲ 0.160	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.079						
									日付	11/28	11/29	11/30	12/1	12/4
									日銀当預残	5,432,500	5,421,600	5,440,600	5,393,600	5,313,600
									準備預金残	4,744,900	4,726,300	4,722,300	4,697,600	4,629,600
									マネタリーベース	6,689,000	6,678,700	6,698,500	6,652,100	6,572,500
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.022%	▲0.022%	▲0.015%	▲0.013%
									コール市場残高	204,715	203,871	191,406	198,485	197,462
									うち無担	176,111	176,761	164,075	169,737	167,338
									うちO/N	101,874	101,784	92,233	96,245	92,086
									うち有担	28,604	27,110	27,331	28,748	30,124

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	372	0.8%	27,000	2023/12/6	2033/9/20	61,839	21,909	100.85	0.707%	25.3095%	100.94	0.697%	5,073	15.85
交付税特会	-	-	13,000	2023/12/15	2024/6/14	532,915	12,990.01		0.000%	2.4376%		0.000%		10

●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	2023/12/6			3,617	1,001	0.005		0.008	5.9
米ドル資金供給		2023/12/7	2023/12/14	5.580	2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/5	2023/12/6	▲0.350	41,181	41,181		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/12/6	2023/12/19	0.000	6,294	6,294				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/5	2023/12/6	▲0.350	0	0				

●2023年12月6日の予定

*10月の米貿易収支

◆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