

Central Daily Market Report

2023年12月11日(月)

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11日 需給速報	2023年12月12日 需給予想	2023年12月13日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	▲ 1,400	▲ 1,000			
財政	▲ 13,400	4,800	▲ 23,000			
資金過不足	▲ 14,500	3,400	▲ 24,000			
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	14,800					
CP等買入		4,000	▲ 500			
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						
国債補充供給	▲ 36,400	37,200	36,400			
当増減	1,100	43,300	▲ 24,000			
当座預金残高	5,297,000	5,340,300	5,316,300			
準備預金残高	4,636,900					
積み終了先	4,636,200			12月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,636,200			積数	1,000	
非準備預金先	660,100			1日平均	200	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,895,300	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	86.67%		

●2023年12月11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。積み最終週となり、引き続き調達ニーズが強いなか、一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。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、▲0.09~▲0.085%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>

11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、数件の入札が実施された。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

2023/12/11	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.086	0.775	0.006	32,791.80	483.94	144.98-00	146.36-39
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.028				-	▲ 0.110						
2W							-	▲ 0.121						
3W							-	▲ 0.169						
1M							-	▲ 0.168						
3M			0.035				▲ 0.156	▲ 0.155						
6M							▲ 0.160	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.076						
									日付	12/4	12/5	12/6	12/7	12/8
									日銀当預残	5,313,600	5,328,000	5,298,500	5,298,800	5,295,900
									準備預金残	4,629,600	4,643,100	4,613,500	4,623,700	4,623,400
									マネタリーベース	6,572,500	6,588,000	6,559,700	6,562,000	6,560,600
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%
									コール市場残高	197,462	195,047	193,677	191,806	192,068
									うち無担	167,338	166,858	166,008	162,933	162,195
									うちO/N	92,086	91,276	91,426	88,411	87,013
									うち有担	30,124	28,189	27,669	28,873	29,873

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/12/11	2023/12/12	▲ 0.350	36,955	36,955		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/11	2023/12/12	▲ 0.350	49	49		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2023年12月12日の予定

*11月の企業物価指数	*米FOMC(1日目)	*5年利付国債入札(25,000億円、12/13発行)
	*11月の米消費者物価指数	*エネルギー対策借入(7,000億円、12/20借入)
	*11月の米財政収支	

◆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