

Central Daily Market Report

2023年12月27日(水)

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27日 需給速報	2023年12月28日 需給予想	2023年12月29日 当社予想			
銀行券	▲ 2,000	▲ 2,700	▲ 2,000			
財政	▲ 200	▲ 3,800	▲ 700			
資金過不足	▲ 2,200	▲ 6,500	▲ 2,700			
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						
CP等買入		▲ 400	▲ 1,500	4,000		
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	▲ 44,700	41,900		44,700		
当増増減	▲ 4,400	36,700	1,300			
当座預金残高	5,449,700	5,486,400	5,487,700			
準備預金残高	4,733,800					
積み終了先	4,732,300			12月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,732,300			積数	16,400	
非準備預金先	715,900			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	99.59%	日数	38.71%		

●2023年12月27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▲0.020~▲0.005%近辺での出会いとなった。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事で、全体の出会い水準も前日比で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>

27日のアウトラ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、月末発行に当たり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。

●短期金融市場関連指標

2023/12/27	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	
	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)	為替(17時)
単位：%									0.595	▲ 0.034	33,681.24	375.39	142.47-49	142.77-79
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.097						
T/N	▲ 0.011	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.109						
S/N							-	-						
1W	0.008	0.015	0.010				-	▲ 0.219						
2W							-	▲ 0.191						
3W							-	▲ 0.179						
1M	0.180	0.350	0.293				-	▲ 0.166						
3M			0.026				▲ 0.220	▲ 0.153						
6M							▲ 0.160	▲ 0.108						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.067						
									日付	12/20	12/21	12/22	12/25	12/26
									日銀当預残	5,446,700	5,448,500	5,448,600	5,453,200	5,454,100
									準備預金残	4,744,300	4,739,200	4,729,700	4,744,000	4,741,400
									マネタリーベース	6,725,400	6,730,200	6,733,100	6,740,100	6,743,400
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%
									コール市場残高	200,963	203,629	211,411	202,992	204,971
									うち無担	177,945	178,269	186,881	175,618	179,081
									うちO/N	91,263	87,647	95,159	82,646	86,104
									うち有担	23,018	25,360	24,530	27,374	25,890

●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)		2023/12/27	2023/12/28	▲ 0.350	45,134	45,134		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/12/27	2023/12/28	▲ 0.350	0	0				

●2023年12月28日の予定

*11月の商業動態統計速報
*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲1.6%)

◆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