

Central Daily Market Report

2024年12月3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	2024年12月3日 需給速報	2024年12月4日 需給予想	2024年12月5日 当社予想
銀行券	▲ 1,000	▲ 1,600	▲ 2,000
財政	▲ 36,500	▲ 87,500	1,000
資金過不足	▲ 37,500	▲ 89,100	▲ 1,000

金融調節	2024年12月3日		2024年12月4日		2024年12月5日	
	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						
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	▲ 4,600	5,900		4,600		
当預増減	▲ 36,200		▲ 84,500		▲ 1,000	

当座預金残高	5,375,200	5,290,700	5,289,700
準備預金残高	4,831,300		
積み終了先	4,831,200		
超過準備	4,830,600		
非準備預金先	543,900		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			3,912,200
準備預金進捗率	実績 99.99%	日数 60.00%	

●短期金融市場関連指標

12/3	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値		
O/N	0.220	0.228	0.227	1W				T+0	0.230	
T/N				2W				T+1	0.240	
S/N				3W		0.350		1W	0.212	
2日				1M		0.420		2W	0.213	
3日				2M				3W	0.227	
4日				3M				1M	0.254	
5日				4M				3M	0.331	
6日				5M				6M	0.387	
有担保コール(速報)				6M				1Y	0.458	
O/N			0.180	1Y						

JGB新発10年債			日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比		15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
1.075	0.000		39,248.86	+735.84	149.51-54	150.01-02
日付		11/26	11/27	11/28	11/29	12/2
日銀当預残		5,436,700	5,431,500	5,423,100	5,431,300	5,411,400
準備預金残		4,884,400	4,877,200	4,865,700	4,867,500	4,846,900
マネタリーベース		6,681,400	6,676,900	6,669,800	6,678,600	6,658,800
無担O/N加重平均		0.228%	0.228%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高		119,628	118,203	117,828	120,387	116,991
うち無担		79,867	78,693	78,863	82,181	77,960
うちO/N		32,347	31,682	31,692	35,100	30,859
うち有担		39,761	39,510	38,965	38,206	39,031

●入札結果

名称	回数	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非償格募入札(億円)	非償格入札(億円)
10年利付国債	376	0.9%	26,000	2024/12/4	2034/9/20	62,107	19,934	98.32	1.089%	20.3093%	98.37	1.084%	6,058	4,18

●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
米ドル資金供給		2024/12/5	2024/12/12	4.830	3	3				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/3	2024/12/4	▲0.050	4,673	4,673		▲0.050	▲0.054	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/3	2024/12/4	▲0.050	20	20		▲0.050	▲0.050	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2024/12/4	2024/12/13	0.220	4	4		0.220	0.220	

●2024年12月4日の予定

*12月の日銀当座預金増減要因見込み	*11月のISM非製造業景況指数 *10月の米製造業新規受注・出荷・在庫 *米ページブック	*交付税特別会計借入(13,000億円、12/13借入)
--------------------	---	------------------------------

◆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

●2024年12月3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、引き続き旺盛な資金調達ニーズを背景に、0.226~0.227%程度で推移した。ターム物は証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.235~0.245%程度での出合いとなった。SCI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>

3日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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、概ね横ばい圏となる0.25%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。