

●資金需給

単位：億円	2024年12月4日 需給速報		2024年12月5日 需給予想		2024年12月6日 当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 2,100		▲ 1,000	
財政	▲ 84,400		1,000		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 85,900		▲ 1,100		▲ 9,000	
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			9,300			
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	▲ 5,100	4,600		5,100		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 86,400		13,300		▲ 9,000	
当座預金残高	5,288,800		5,302,100		5,293,100	
準備預金残高	4,740,200					
積み終了先	4,740,100		12月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,740,100					
非準備預金先	548,600		積数 500			
			1日平均 0			
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		63.33%	

●2024年12月4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%程度での出会いとなった。
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＞

4日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出合いが見られた。

＜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。

●短期金融市場関連指標

12/4	無担保コール（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	0.200	0.275	0.227	1W	0.226	0.278	0.243		T+0	0.237	1.050	▲ 0.025	39,276.39	+27.53	149.60-63	150.39-42
T/N				2W			0.290		T+1	0.240						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.212						
3日				2M					2W	0.213						
4日				3M	0.470	0.600	0.548		3W	0.227						
5日				4M					1M	0.254						
6日				5M				3M	0.145	3M	0.333					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.190	6M	0.386					
O/N			0.180	1Y				1Y	0.440	1Y	0.459					
日付																
11/27																
11/28																
11/29																
12/2																
12/3																
日銀当預残	5,431,500	5,423,100	5,431,300	5,411,400	5,375,200											
準備預金残	4,877,200	4,865,700	4,867,500	4,846,900	4,831,300											
マネタリーベース	6,676,900	6,669,800	6,678,600	6,658,800	6,623,500											
無担O/N加重平均	0.228%	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%											
コール市場残高	118,203	117,828	120,387	116,991	117,763											
うち無担	78,693	78,863	82,181	77,960	77,758											
うちO/N	31,682	31,692	35,100	30,859	30,207											
うち有担	39,510	38,965	38,206	39,031	40,005											

●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I非価格競争入札（億円）
交付税特会	-	-	13,000	2024/12/13	2025/6/13	59,713	13,000.04		0.500%	23.0400%		0.484%	

●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	全取レート・利回較差	平均落札レート・利回較差	按分比率
国債買入（残存期間1年以下）	1,500	2024/12/5			2,139	1,501	▲0.049		▲0.020	34.8
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,250	2024/12/5			9,155	3,255	▲0.012		▲0.010	75.5
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,250	2024/12/5			7,117	3,259	▲0.009		▲0.008	77.6
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,500	2024/12/5			3,464	1,506	▲0.003		▲0.001	44.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/12/4	2024/12/5	▲0.050	5,212	5,212		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/12/4	2024/12/5	▲0.050	0	0				

●2024年12月5日の予定

*広島県金融経済懇談会にて 中村日銀審議委員講演	*10月の米貿易収支	*30年利付国債入札 (9,000億円、12/6発行)
-----------------------------	------------	--------------------------------

◆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ことがあります。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