

●資金需給

単位：億円	2024年12月10日 需給速報	2024年12月11日 需給予想	2024年12月12日 当社予想			
銀行券	▲ 1,800	▲ 1,500	▲ 3,000			
財政	▲ 3,900	▲ 25,900	▲ 2,000			
資金過不足	▲ 5,700	▲ 27,400	▲ 5,000			
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			8,000	▲ 8,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	7,700					
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	▲ 3,400	5,900		3,400		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	4,500	▲ 24,000	▲ 5,000			
当座預金残高	5,278,400	5,254,400	5,249,400			
準備預金残高	4,723,600					
積み終了先	4,723,500	12月11日以降の残り所要積立額 積数 100 1日平均 0				
超過準備	4,723,500					
非準備預金先	554,800					
積み期間（11/16～12/15）の所要準備額				3,921,500		
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	83.33%		

●2024年12月10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、引き続き邦銀業態を中心に調達ニーズが強く、出合いの中心は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。

＜レボ市場＞
GC T/Nは、0.235～0.255%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＞
10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物と1Y物で出合いが見られた。

＜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

12/10	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	0.220	0.275	0.227	1W			0.390			T+0	0.243	1.060	+0.025	39,367.58	+207.08	151.37-39	151.55-57
T/N			0.200	2W			T+1			0.247							
S/N				3W													
2日				1M			1W			0.226							
3日				2M			2W			0.237							
4日				3M	0.500	0.520	0.510			3W	0.246						
5日				4M						1M	0.254						
6日				5M						3M	0.145	3M	0.348				
有担保コール（速報）				6M				6M	0.300	6M	0.391						
O/N			0.180	1Y				1Y	0.425	1Y	0.480						

日付	12/3	12/4	12/5	12/6	12/9
日銀当預残	5,375,200	5,288,800	5,298,200	5,290,300	5,273,900
準備預金残	4,831,300	4,740,200	4,746,600	4,738,400	4,721,500
マネタリーベース	6,623,500	6,538,600	6,550,100	6,543,400	6,528,200
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.232%	0.227%	0.227%
コール市場残高	117,763	119,251	121,270	119,371	119,513
うち無担	77,758	79,762	82,052	79,987	80,505
うちO/N	30,207	31,371	33,961	30,596	30,784
うち有担	40,005	39,489	39,218	39,384	39,008

●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）
5年利付国債	174	0.7%	23,000	2024/12/11	2029/9/20	77,340	17,507	99.83	0.736%	5.3409%	99.84	0.734%	5,484
エネルギー対策	-	-	7,430	2024/12/20	2025/12/22	31,367	7,430		0.550%	30.0000%		0.541%	

●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		2024/12/12	2024/12/19	4.830	1	1				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/12/10	2024/12/11	▲0.050	3,413	3,413		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2024/12/11	2024/12/25	0.250	24,115	8,008				33.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/12/10	2024/12/11	▲0.050	0	0				

●2024年12月11日の予定

*11月の企業物価指数	*11月の米消費者物価指数
*10-12月期の法人企業景気予測調査季報	*11月の米財政収支

◆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論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