

# Central Daily Market Report

2024年12月13日(金)

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13日 需給速報	2024年12月16日 需給予想	2024年12月17日 当社予想
銀行券	▲ 1,900	▲ 1,400	▲ 2,000
財政	68,600	▲ 1,200	1,000
資金過不足	66,700	▲ 2,600	▲ 1,000

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	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			11,600					
CP等買入								
貸出支援基金(成)								
貸出支援基金(貸)	33,800	▲ 46,200						
被災地支援		▲ 100						
社債等買入								
気候変動対応オペ								
E T F買入								
国債補完供給	▲ 3,200	4,300		3,200				
当預増減	55,300		12,200		▲ 1,000			

当座預金残高	5,311,000	5,323,200	5,322,200	
準備預金残高	4,783,900			
積み終了先	4,783,900			
超過準備	4,783,900			
非準備預金先	527,100			
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額			4,063,800	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%

## ●短期金融市場関連指標

12/13	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート	
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値		平均値	
O/N	0.200	0.228	0.227	1W					T+0	0.242
T/N				2W					T+1	0.247
S/N				3W					1W	0.231
2日				1M		0.540			2W	0.237
3日			0.278	2M					3W	0.239
4日			0.380	3M					1M	0.246
5日				4M					3M	0.350
6日				5M			3M	0.160	6M	0.394
有担保コール(速報)				6M			6M	0.265	1Y	0.488
O/N			0.180	1Y			1Y	0.420		

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)
1.035	▲ 0.010	39,470.44	▲ 378.70	152.59-61	152.79-81
日付	12/6	12/9	12/10	12/11	12/12
日銀当預残	5,290,300	5,273,900	5,278,400	5,249,600	5,255,700
準備預金残	4,738,400	4,721,500	4,723,600	4,709,600	4,710,800
マネタリーベース	6,543,400	6,528,200	6,534,600	6,507,300	6,516,200
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	119,371	119,513	120,018	118,938	118,682
うち無担	79,987	80,505	81,308	79,613	79,533
うちO/N	30,596	30,784	31,317	29,672	29,462
うち有担	39,384	39,008	38,710	39,325	39,149

## ●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)
国庫短期証券	1275	-	43,000	2024/12/16	2025/3/24	86,148	32,499.6	99.9585	0.1546%	95.3191%	99.9610	0.1453%	10,500

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2024/12/16			5,828	3,253	▲0.015		▲0.012	12.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/12/16			6,442	3,252	▲0.025		▲0.019	8.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/12/16			10,801	3,755	▲0.013		▲0.011	44.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/12/16			3,178	1,506	0.000		0.003	45.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/13	2024/12/16	▲0.050	3,252	3,252		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/13	2024/12/16	▲0.050	0	0				

## ●2024年12月16日の予定

*10月の機械受注統計 (市場予想:船舶、電力除く民需、前月比+1.2%)	*10月の第3次産業活動指数
--	----------------

◆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場合があります。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