

Central Daily Market Report

2024年12月16日(月)

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16日 需給速報	2024年12月17日 需給予想	2024年12月18日 当社予想			
銀行券	▲ 1,400	▲ 2,700	▲ 2,000			
財政	1,700	▲ 2,200	▲ 10,000			
資金過不足	300	▲ 4,900	▲ 12,000			
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	11,600					
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			▲ 700			
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 4,300	3,200	4,300			
当預増減	10,800	▲ 1,300	▲ 12,000			
当座預金残高	5,321,800	5,320,500	5,308,500			
準備預金残高	4,790,100					
積み終了先	3,375,800			12月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,259,300			積数	532,900	
非準備預金先	531,700			1日平均	17,800	
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	86.89%	日数	3.23%		

●2024年12月16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、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られており、出合いの水準は0.226~0.227%程度の横ばい圏で推移した。
ターム物は、幅広い期間で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.24~0.245%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>

16日のアウトラ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。

●短期金融市場関連指標

12/16	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	0.219	0.275	0.227	1W	0.231	0.400	0.259		T+0	0.239	1.064	+0.029	39,457.49	▲ 12.95	153.45-48	153.50-52
T/N				2W					T+1	0.243						
S/N				3W					1W	0.231						
2日			0.227	1M					2W	0.233						
3日				2M					3W	0.236						
4日				3M					1M	0.241						
5日				4M					3M	0.350						
6日				5M					6M	0.396						
有担保コール(速報)				6M					1Y	0.489						
O/N			0.180	1Y					1Y	0.489						

日付	12/9	12/10	12/11	12/12	12/13
日銀当預残	5,273,900	5,278,400	5,249,600	5,255,700	5,311,000
準備預金残	4,721,500	4,723,600	4,709,600	4,710,800	4,783,700
マネタリーベース	6,528,200	6,534,600	6,507,300	6,516,200	6,573,400
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	119,513	120,018	118,938	118,682	118,621
うち無担	80,505	81,308	79,613	79,533	79,459
うちO/N	30,784	31,317	29,672	29,462	29,398
うち有担	39,008	38,710	39,325	39,149	39,162

●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	応募総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/16	2024/12/17	▲0.050	4,469	4,469		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/16	2024/12/17	▲0.050	0	0				

●2024年12月17日の予定

*米FOMC(1日目) *11月の米小売売上高 *11月の米鉱工業生産・設備稼働率 *10月の米企業在庫	*20年利付国債入札 (10,000億円、12/18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