

Central Daily Market Report

2024年12月17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17日 需給速報	2024年12月18日 需給予想	2024年12月19日 当社予想			
銀行券	▲ 2,700	▲ 2,700	▲ 300			
財政	2,500	▲ 15,600	1,000			
資金過不足	▲ 200	▲ 18,300	700			
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						
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	▲ 3,700	4,300		3,700		
当預増減	▲ 300	▲ 14,600				700
当座預金残高	5,321,500	5,306,900				5,307,600
準備預金残高	4,795,300					
積み終了先	4,699,900					
超過準備	4,365,000					
非準備預金先	526,200					
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	97.49%	日数			6.45%

●2024年12月17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、出会いの水準は0.226~0.227%程度と横ばい圏で推移した。
ターム物は、決定会合を直前に控えていることから、様子見姿勢を取る先も多く、閑散とした状況となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.24~0.245%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>

17日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<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

12/17	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					T+0	0.237	1.075	+0.011	39,364.68	▲ 92.81	154.08-11	154.06-08
T/N				2W					T+1	0.244						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.233						
3日				2M					2W	0.233						
4日				3M		0.500			3W	0.236						
5日				4M					1M	0.239						
6日				5M				3M	0.125	0.348						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.265	0.396						
O/N			0.180	1Y				1Y	0.420	0.489						

日付	12/10	12/11	12/12	12/13	12/16
日銀当預残	5,278,400	5,249,600	5,255,700	5,311,000	5,321,800
準備預金残	4,723,600	4,709,600	4,710,800	4,783,700	4,790,400
マネタリーベース	6,534,600	6,507,300	6,516,200	6,573,400	6,585,500
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	120,018	118,938	118,682	118,621	121,836
うち無担	81,308	79,613	79,533	79,459	81,716
うちO/N	31,317	29,672	29,462	29,398	30,875
うち有担	38,710	39,325	39,149	39,162	40,120

●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I非価格競争入札(億円)
20年利付国債	190	1.8%	10,000	2024/12/18	2044/9/20	25,525	7,555	98.80	1.883%	79.9218%	98.85	1.879%	2,433

●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		2024/12/19	2024/12/27	4.620	1	1				
社債等買入	250	2024/12/20			1,014	250	1.362		1.780	57.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/17	2024/12/18	▲0.050	3,862	3,862		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/17	2024/12/18	▲0.050	0	0				

●2024年12月18日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目)	*米FOMC(2日目)	*国庫短期証券(1276回)入札(1年、32,000億円、12/20発行)
*11月の貿易統計	*FRB 米経済見通し発表	
*7-9月期の資金循環統計速報	*11月の米住宅着工件数	
*10月の石油等消費動態統計	*11月のユーロ圏消費者物価指数改定値	
	*11月の英消費者物価指数	

◆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