

Central Daily Market Report

2024年12月19日(木)

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19日 需給速報		2024年12月20日 需給予想		2024年12月23日 当社予想					
銀行券	▲ 3,000		▲ 2,700		▲ 3,000					
財政	4,500		48,700		▲ 2,000					
資金過不足	1,500		46,000		▲ 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										
国債買現										
国債売現										
国庫短期証買入										
国債買入										
CP等買入				▲ 400						
貸出支援基金(成)										
貸出支援基金(貸)										
被災地支援										
社債等買入			300	▲ 500						
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 4,300	4,000		4,300						
※ F T L資金供給用国債国債供給										
当預増減	1,200		49,700		▲ 5,000					
当座預金残高	5,302,300		5,352,000		5,347,000					
準備預金残高	4,796,100		12月20日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>37,700</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>1,400</td></tr></table>				積数	37,700	1日平均	1,400
積数	37,700									
1日平均	1,400									
積み終了先	4,784,800									
超過準備	4,779,700									
非準備預金先	506,200									
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 99.07%		日数		12.90%					

●短期金融市場関連指標

12/19				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	0.219	0.228	0.227	1W	0.231	0.390	0.288			T+0	0.239
T/N				2W						T+1	0.251
S/N				3W	0.300	0.330	0.311				
2日				1M			0.310			1W	0.232
3日				2M						2W	0.231
4日				3M						3W	0.235
5日				4M						1M	0.239
6日			0.380	5M						3M	0.115
有担保コール(速報)				6M				6M	0.265	6M	0.397
O/N			0.180	1Y				1Y	0.460	1Y	0.489

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	終値	前日比	為替(9時)	為替(17時)
1.080	+0.020	38,813.58	▲ 268.13	154.66-69	156.46-49
日付					
12/12	12/13	12/16	12/17	12/18	
日銀当預残	5,255,700	5,311,000	5,321,800	5,321,500	5,301,100
準備預金残	4,710,800	4,783,700	4,790,400	4,795,300	4,784,700
マネタリーベース	6,516,200	6,573,400	6,585,500	6,588,000	6,570,400
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.226%
コール市場残高	118,682	118,621	121,836	122,324	120,477
うち無担	79,533	79,459	81,716	82,799	81,470
うちO/N	29,462	29,398	30,875	32,538	32,609
うち有担	39,149	39,162	40,120	39,525	39,007

●入札結果

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/19	2024/12/20	▲0.050	4,462	4,462		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/19	2024/12/20	▲0.050	0	0				

●日銀 金融政策決定会合・結果

当面の金融政策運営について
●日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(賛成8反対1)。 無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0.25%程度で推移するよう促す。
●本会合では、2023年4月以降実施してきた「金融政策の多角的レビュー」を取りまとめた。

●2024年12月20日の予定

*11月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.6%)	*11月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1277回)入札 (3か月、43,000億円、12/23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

●2024年12月19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%程度と横ばい圏で推移した。
ターム物については、追加利上げが見送られたことを受け、後場から幅広い期間で引き合いが散見された。

なお、本日開催された日銀金融政策決定会合では、政策金利の現状維持が決定された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.24~0.255%程度での出合いとなった。
SC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＞

19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発行市場は数件の入札が実施された。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。