

Central Daily Market Report

2024年12月20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20日 需給速報		2024年12月23日 需給予想		2024年12月24日 当社予想							
銀行券	▲ 2,700		▲ 2,400		▲ 3,000							
財政	45,300		▲ 7,600		1,000							
資金過不足	42,600		▲ 10,000		▲ 2,000							
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			11,400									
CP等買入		▲ 400		▲ 300								
貸出支援基金（成）												
貸出支援基金（貸）												
被災地支援												
社債等買入	200	▲ 500										
気候変動対応オペ												
E T F 買入												
国債補完供給	▲ 11,600	4,300		11,600								
※ FDL資金供給用国債補完供給												
当預増減	34,600		12,700		▲ 2,000							
当座預金残高	5,336,900		5,349,600		5,347,600							
準備預金残高	4,805,400		<table><tr><td colspan="2">12月23日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>17.900</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>700</td></tr></table>				12月23日以降の残り所要積立額		積数	17.900	1日平均	700
12月23日以降の残り所要積立額												
積数	17.900											
1日平均	700											
積み終了先	4,803,800											
超過準備	4,798,800											
非準備預金先	531,500											
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 99.56%		日数		22.58%							

●2024年12月20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。
ターム物は、幅広い期間で引き合いが散見された。

＜レボ市場＞

GC T/Nは、0.24～0.245%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＞

20日はTDB3M物（第1277回）の入札が実施され、結果は平均利回りが強く、テールが流れる展開となったものの、結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。
このほか、1Y物でも少額の出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数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。

●短期金融市場関連指標

12/20	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	終値	前日比	為替（9時）	為替（17時）
O/N	0.200	0.228	0.227	1W	0.269	0.400	0.299		T+0	0.234	1.050	▲ 0.030	38,701.90	▲ 111.68	157.64-67	156.81-84
T/N				2W					T+1	0.242						
S/N				3W												
2日				1M	0.290	0.310	0.303		1W	0.229						
3日				2M					2W	0.228						
4日				3M			0.460		3W	0.228						
5日				4M					1M	0.233						
6日			0.227	5M				3M	0.130	3M	0.331					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.240	6M	0.397					
O/N			0.180	1Y				1Y	0.410	1Y	0.490					
日付																
日銀当預残																
準備預金残																
マネタリーベース																
無担O/N加重平均																
コール市場残高																
うち無担																
うちO/N																
うち有担																

●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	1277	-	43,000	2024/12/23	2025/3/31	83,351	33,147.7	99.9610	0.1453%	71.0193%	99.9663	0.1255%	9.852

●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	2024/12/23			9,235	3,253	▲0.050		▲0.046	15.5
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,250	2024/12/23			12,986	3,253	▲0.051		▲0.050	92.5
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,750	2024/12/23			9,218	3,756	▲0.048		▲0.047	73.9
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,500	2024/12/23			2,529	1,502	▲0.034		▲0.024	38.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/12/20	2024/12/23	0.050	12,104	12,104		0.050	0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/12/20	2024/12/23	0.050	0	0				

●2024年12月23日の予定

*7-9月期の英GDP確報値

◆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