

●資金需給

単位：億円	2024年12月23日 需給速報	2024年12月24日 需給予想	2024年12月25日 当社予想
銀行券	▲ 2,400	▲ 2,900	▲ 3,000
財政	▲ 11,900	▲ 6,200	1,000
資金過不足	▲ 14,300	▲ 9,100	▲ 2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 8,000
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		▲ 300	▲ 100
貸出支援基金（成）			
貸出支援基金（貸）			
被災地支援			
社債等買入			
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 10,200	11,600	10,200
※ドル資金供給用国債国債供給			
当預増減	▲ 1,800	1,000	▲ 10,000
当座預金残高	5,335,100	5,336,100	5,326,100
準備預金残高	4,830,700		
積み終了先	4,828,600		12月24日以降の残り所要積立額
超過準備	4,828,600		積数 15,800
非準備預金先	504,400		1日平均 700
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	99.61%	日数 25.81%

●2024年12月23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、週末要因が剥落したものの相場に大きな変化はなく、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、出合いの水準は0.226～0.227%程度と横ばい圏で推移した。
ターム物も引き続き、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%程度での出会いとなった。
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＞
23日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞
CP発行市場は、五・十日発行にあたり、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

12/23	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	0.219	0.228	0.227	1W					T+0	0.235	1.060	+0.010	39,161.34	+459.44	156.57-60	156.79-80
T/N				2W			0.231		T+1	0.239						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.221						
3日				2M					2W	0.218						
4日				3M	0.500	0.550	0.533		3W	0.224						
5日				4M					1M	0.229						
6日				5M				3M	0.130	3M	0.328					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.240	6M	0.396					
O/N			0.180	1Y				1Y	0.415	1Y	0.492					

日付	12/16	12/17	12/18	12/19	12/20
日銀当預残	5,321,800	5,321,500	5,301,100	5,302,300	5,336,900
準備預金残	4,790,400	4,795,300	4,784,700	4,796,100	4,808,000
マネタリーベース	6,585,500	6,588,000	6,570,400	6,574,500	6,611,900
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.226%	0.227%	0.227%
コール市場残高	121,836	122,324	120,477	119,610	118,613
うち無担	81,716	82,799	81,470	80,958	77,261
うちO/N	30,875	32,538	32,609	33,307	33,750
うち有担	40,120	39,525	39,007	38,652	41,352

●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）		2024/12/23	2024/12/24	▲0.050	10,250	10,250		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/12/23	2024/12/24	▲0.050	216	216		▲0.050	▲0.050	

●2024年12月24日の予定

*金融政策決定会合議事要旨（10月30・31日分）	*12月の米CB消費者信頼感指数 *11月の米耐久財新規受注 *11月の米新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札（4,000億円、12/25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論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