

# Central Daily Market Report

2024年12月24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24日 需給速報	2024年12月25日 需給予想	2024年12月26日 当社予想	
銀行券	▲ 2,900	▲ 2,600	▲ 2,000	
財政	▲ 10,300	3,400	▲ 2,000	
資金過不足	▲ 13,200	800	▲ 4,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出				
全店共通		8,000	▲ 8,000	
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入				
CP等買入		▲ 100	▲ 200	
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援				
社債等買入			▲ 500	
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 6,300	7,700	6,300	
当預増減	▲ 11,900	6,400	▲ 4,000	
当座預金残高	5,323,200	5,329,600	5,325,600	
準備預金残高	4,818,200			
積み終了先	4,816,300			12月25日以降の残り所要積立額
超過準備	4,816,300			積数 13,800
非準備預金先	505,000			1日平均 600
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 99.66%			日数 29.03%

## ●2024年12月24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、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、0.24~0.25%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>

24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、複数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

12/24	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	売買取参考統計値		平均値	
O/N	0.219	0.228	0.227	1W					T+0	0.244
T/N				2W	0.295	0.320	0.303		T+1	0.238
S/N				3W					1W	0.203
2日				1M					2W	0.209
3日				2M					3W	0.218
4日				3M	0.460	0.580	0.500		1M	0.223
5日			0.390	4M					3M	0.324
6日				5M					6M	0.396
有担保コール(速報)				6M			6M	0.240	1Y	0.492
O/N			0.180	1Y			1Y	0.420		

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)	
1.065	+0.005	39,036.85	▲ 124.49	157.16-19	157.14-15	
日付	12/17	12/18	12/19	12/20	12/23	
日銀当預残	5,321,500	5,301,100	5,302,300	5,336,900	5,335,100	
準備預金残	4,795,300	4,784,700	4,796,100	4,808,000	4,832,600	
マネタリーベース	6,588,000	6,570,400	6,574,500	6,611,900	6,612,500	
無担O/N加重平均	0.227%	0.226%	0.227%	0.227%	0.227%	
コール市場残高	122,324	120,477	119,610	118,613	114,969	
うち無担	82,799	81,470	80,958	77,261	74,736	
うちO/N	32,538	32,609	33,307	33,750	31,370	
うち有担	39,525	39,007	38,652	41,352	40,233	

## ●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)
流動性供給	420	-	4,000	2024/12/25	-	12,633	3,989		▲0.016%	43.5783%		▲0.017%	

## ●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
米ドル資金供給		2024/12/27	2025/1/9	4.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/24	2024/12/25	▲0.050	6,393	6,393		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/12/25	2025/1/8	0.250	13,867	8,005				57.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/24	2024/12/25	▲0.050	0	0				

## ●2024年12月25日の予定

*植田日銀総裁 日本経済団体連合会審議員会で講演
*11月の企業向けサービス価格指数
*10月の景気動向指数改訂状況

◆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