

Central Daily Market Report

2024年12月25日 (水)
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25日 需給速報	2024年12月26日 需給予想	2024年12月27日 当社予想
銀行券	▲ 2,600	▲ 2,700	▲ 2,000
財政	4,200	11,100	▲ 3,000
資金過不足	1,600	8,400	▲ 5,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		8,500	
CP等買入		▲ 200	▲ 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		▲ 500	
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 5,700	6,300	5,700
※ F T F 資金供給用国債国債供給			
当預増減	1,500	22,500	▲ 5,000
当座預金残高	5,324,700	5,347,200	5,342,200
準備預金残高	4,837,800		
積み終了先	4,836,100		12月26日以降の残り所要積立額
超過準備	4,836,000		積数 12,000
非準備預金先	486,900		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	99.70%	日数 32.26%

●2024年12月25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、幅広い期間での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＞

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出合いが見られた。

＜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、概ね横ばい圏で推移した。
また本日は、CP等買入オペが事前予定通り2,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.457%、平均落札レート0.534%と、前回(按分0.452、平均0.483%)比で按分、平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

12/25	無担保コール(速報)							短国	東京レボレート
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					T+0 0.247
T/N				2W			0.320		T+1 0.239
S/N				3W					
2日				1M			0.350		1W 0.201
3日				2M					2W 0.207
4日			0.380	3M			0.460		3W 0.216
5日				4M					1M 0.223
6日				5M				3M 0.140	3M 0.324
有担保コール(速報)				6M				6M 0.240	6M 0.396
O/N			0.180	1Y				1Y 0.420	1Y 0.492

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	0.000	39,130.43	+93.58	157.05-14	157.00-30
日付					
12/18		12/19	12/20	12/23	12/24
日銀当預残		5,301,100	5,302,300	5,336,900	5,335,100
準備預金残		4,784,700	4,796,100	4,808,000	4,832,600
マネタリーベース		6,570,400	6,574,500	6,611,900	6,612,500
無担保O/N加重平均		0.226%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高		120,477	119,610	118,613	114,969
うち無担		81,470	80,958	77,261	74,736
うちO/N		32,609	33,307	33,750	31,370
うち有担		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	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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/12/26			10,215	3,254	▲0.011		▲0.009	54.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/12/26			11,139	3,754	▲0.010		▲0.008	56.0
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/12/26			2,659	753	▲0.004		▲0.003	19.1
国債買入(物価連動債)	600	2024/12/26			2,501	600	▲0.250		▲0.327	4.4
CP等買入	2,000	2024/12/30			4,677	1,992	0.457		0.534	13.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/25	2024/12/26	▲0.050	5,878	5,878		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/25	2024/12/26	▲0.050	0	0				

●2024年12月26日の予定

*11月の住宅着工統計	*EURO祝日(Christmas Holiday) *London祝日(Boxing Day)	*2年利付国債入札 (26,000億円、1/6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		