

●資金需給

単位：億円	2024年12月26日 需給速報		2024年12月27日 需給予想		2024年12月30日 当社予想	
銀行券	▲ 2,700		▲ 2,100		▲ 300	
財政	12,900		▲ 6,400		▲ 6,400	
資金過不足	10,200		▲ 8,500		▲ 6,700	
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	8,500					
CP等買入		▲ 100		▲ 700	2,000	
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	▲ 7,000	5,700		7,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	17,300		▲ 2,200		▲ 4,700	
当座預金残高	5,342,000		5,339,800		5,335,100	
準備預金残高	4,840,900					
積み終了先	4,840,000		12月27日以降の残り所要積立額 積数 10,600 1日平均 500			
超過準備	4,839,400					
非準備預金先	501,100					
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 99.74%		日数		35.48%	

●2024年12月26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。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.235~0.245%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＞

26日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で少額の出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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

12/26	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	0.241	1.085	+0.020	39,568.06	+437.63	157.11-13	157.35-37
T/N				2W	0.233	0.350	0.292			T+1	0.238						
S/N				3W			0.350										
2日				1M	0.320	0.330	0.326			1W	0.201						
3日				2M						2W	0.206						
4日				3M			0.575			3W	0.214						
5日				4M						1M	0.223						
6日				5M						3M	0.170						
有担保コール(速報)				6M				6M	0.240	3M	0.323						
O/N			0.180	1Y				1Y	0.420	6M	0.396						
日付																	
		12/19	12/20	12/23	12/24	12/25											
日銀当預残		5,302,300	5,336,900	5,335,100	5,323,200	5,324,700											
準備預金残		4,796,100	4,808,000	4,832,600	4,818,400	4,837,800											
マネタリーベース		6,574,500	6,611,900	6,612,500	6,603,500	6,607,600											
無担O/N加重平均		0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%											
コール市場残高		119,610	118,613	114,969	116,695	115,021											
うち無担		80,958	77,261	74,736	76,242	75,096											
うちO/N		33,307	33,750	31,370	29,756	29,880											
うち有担		38,652	41,352	40,233	40,453	39,925											

●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)
2年利付国債	468	0.6%	26,000	2025/1/6	2027/1/1	78,998	20,015	99.990	0.605%	74.6772%	99.995	0.602%	5.981

●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)		2024/12/26	2024/12/27	▲0.050	7,168	7,168		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/26	2024/12/27	▲0.050	0	0				

●2024年12月27日の予定

*決定会合における主な意見(12月18・19日分)	*11月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲3.4%)
*12月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.5%)	*11月の有効求人倍率(市場予想:1.25倍)	*11月の商業動態統計速報

◆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