

Central Daily Market Report

2024年12月27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27日 需給速報		2024年12月30日 需給予想		2025年1月6日 当社予想					
銀行券	▲ 2,000		▲ 200		2,300					
財政	▲ 11,700		▲ 10,700		5,000					
資金過不足	▲ 13,700		▲ 10,900		7,300					
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						▲ 30,000				
国債買現										
国債売現										
国庫短期証買入										
国債買入										
CP等買入		▲ 700	2,000	▲ 1,600						
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	▲ 6,400	7,000		6,400						
※ドル資金供給用担保国債供給										
当預増減	▲ 13,800		▲ 4,100		▲ 22,700					
当座預金残高	5,328,200		5,324,100		5,301,400					
準備預金残高	4,829,900		12月30日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>8,500</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>500</td></tr></table>				積数	8,500	1日平均	500
積数	8,500									
1日平均	500									
積み終了先	4,829,400									
超過準備	4,829,200									
非準備預金先	498,300									
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 99.79%		日数		45.16%					

●2024年12月27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3日積みとなった事により資金調達ニーズが一段と強まる展開となったものの、出会いの水準に大きな変化はなく、0.226～0.227%程度の横這い圏で推移した。
ターム物は、1月スタート物での出会いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.20～0.255%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＞

27日のアウトライト市場は、動意に乏しく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、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

12/27	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	0.221	0.228	0.227	1W						T+0	0.241	1.100	+0.015	40,281.16	+713.10	157.76-78	157.81-83
T/N			0.410	2W						T+1	0.239						
S/N				3W													
2日				1M						1W	0.223						
3日				2M						2W	0.218						
4日				3M						3W	0.218						
5日				4M						1M	0.230						
6日				5M						3M	0.324						
有担保コール（速報）				6M				6M	0.240	6M	0.396						
O/N			0.180	1Y				1Y	0.430	1Y	0.492						
日付																	
日銀当預残		5,336,900		5,335,100		5,323,200		5,324,700		5,342,000							
準備預金残		4,808,000		4,832,600		4,818,400		4,837,800		4,840,900							
マネタリーベース		6,611,900		6,612,500		6,603,500		6,607,600		6,627,600							
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		118,613		114,969		116,695		115,021		113,436							
うち無担		77,261		74,736		76,242		75,096		74,102							
うちO/N		33,750		31,370		29,756		29,880		28,686							
うち有担		41,352		40,233		40,453		39,925		39,334							

●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）		2024/12/27	2024/12/30	▲0.050	6,579	6,579		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/12/27	2024/12/30	▲0.050	0	0				

●2024年12月30日の予定

*証券取引所大納会	*12月のシカゴPM景況感指数
-----------	-----------------

◆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