

# Central Daily Market Report

2024年12月30日(月)

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30日 需給速報	2025年1月6日 需給予想	2025年1月7日 当社予想			
銀行券	▲ 100	2,700	3,200			
財政	▲ 11,700	▲ 2,100	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 11,800	600	▲ 3,800			
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	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	▲ 8,000	6,400		8,000		
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減	▲ 13,000	▲ 21,400		▲ 3,800		
当座預金残高	5,315,200	5,293,800		5,290,000		
準備預金残高	4,813,800					
積み終了先	4,813,000			1月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,812,900			積数	2,300	
非準備預金先	501,400			1日平均	200	
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	99.94%		日数	67.74%	

## ●2024年12月30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、年末年始を挟む7日積みとなったことから、一部の先で調達を控える動きが見られた。しかし、0.227%近辺では引き続きしっかりとした調達ニーズも見られたため、出会い水準に大きな変化はなく、0.226~0.227%程度の横這い圏での推移となった。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、0.25~0.255%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>

30日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP市場では、年内最終営業日となったが、既に休暇入りしている事業法人も多いため、入札案件もなく閑散としたマーケットとなった。

## ●短期金融市場関連指標

12/30	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	売買参考統計値		平均値		
O/N	0.200	0.227	0.227	1W					T+0	0.244	
T/N				2W					T+1	0.245	
S/N				3W	0.290	0.330	0.296		1W	0.223	
2日				1M			0.370		2W	0.223	
3日				2M					3W	0.224	
4日			0.380	3M					1M	0.235	
5日				4M			0.510		3M	0.325	
6日				5M				3M	0.215	6M	0.240
有担保コール(速報)				6M				6M	0.397	1Y	0.494
O/N			0.180	1Y				1Y	0.430		

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)
1.090	▲ 0.010	39,894.54	▲ 386.62	157.88-92	157.88-90
日付	12/23	12/24	12/25	12/26	12/27
日銀当預残	5,335,100	5,323,200	5,324,700	5,342,000	5,328,200
準備預金残	4,832,600	4,818,400	4,837,800	4,840,900	4,830,000
マネタリーベース	6,612,500	6,603,500	6,607,600	6,627,600	6,615,800
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	114,969	116,695	115,021	113,436	115,335
うち無担	74,736	76,242	75,096	74,102	76,029
うちO/N	31,370	29,756	29,880	28,686	30,063
うち有担	40,233	40,453	39,925	39,334	39,306

## ●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)		2024/12/30	2025/1/6	▲0.050	8,229	8,229		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/30	2025/1/6	▲0.050	0	0				

## ●2024年12月31日の予定

*10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
------------------------

## ●2025年1月2日の予定

*11月の米建設支出
------------

## ●2025年1月3日の予定

*12月のISM製造業景況指数
-----------------

## ●2025年1月6日の予定

*11月の米製造業新規受注・出荷・在庫
---------------------

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願い申し上げます。

◆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