

# Central Daily Market Report

2024年12月9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9日 需給速報	2024年12月10日 需給予想	2024年12月11日 当社予想
銀行券	▲ 1,300	▲ 1,700	▲ 1,000
財政	▲ 13,000	▲ 1,900	▲ 26,000
資金過不足	▲ 14,300	▲ 3,600	▲ 27,000

金融調節	スタート		エンド		スタート		エンド	
	貸出	貸入	貸出	貸入	貸出	貸入	貸出	貸入
全店共通								▲ 8,000
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入								
国債買入			7,700					
CP等買入		▲ 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		▲ 200						
気候変動対応オペ								
E T F買入								
国債補完供給	▲ 5,900	4,100		5,900				
当預増減	▲ 16,400		10,000		▲ 35,000			

当座預金残高	5,273,900	5,283,900	5,248,900
準備預金残高	4,725,300		
積み終了先	4,725,300		
超過準備	4,725,300		
非準備預金先	548,600		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			3,912,500
準備預金進捗率	実績 99.99%	日数 80.00%	

## ●2024年12月9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、週末要因が剥落したものの相場に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強いなか、レートは0.226~0.227%程度で推移した。  
ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.235~0.25%程度での出会いとなった。  
SCI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>

9日はTDBGM物(第1274回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。

### <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

12/9	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	0.220	0.275	0.227	1W	0.227	0.230	0.227		T+0	0.243
T/N				2W					T+1	0.240
S/N				3W						
2日				1M					1W	0.219
3日				2M					2W	0.234
4日				3M					3W	0.246
5日				4M					1M	0.264
6日			0.380	5M				3M	0.145	0.346
有担保コール(速報)				6M				6M	0.295	0.391
O/N			0.180	1Y				1Y	0.440	0.475

JGB新発10年債		日経平均株価			ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
1.035	▲ 0.015	39,160.50	+69.33	149.87~90	150.33~35	
日付		12/2	12/3	12/4	12/5	12/6
日銀当預残	5,411,400	5,375,200	5,288,800	5,298,200	5,290,300	
準備預金残	4,846,900	4,831,300	4,740,200	4,746,600	4,738,400	
マネタリーベース	6,658,800	6,623,500	6,538,600	6,550,100	6,543,400	
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.232%	0.227%	
コール市場残高	116,991	117,763	119,251	121,270	119,371	
うち無担	77,960	77,758	79,762	82,052	79,987	
うちO/N	30,859	30,207	31,371	33,961	30,596	
うち有担	39,031	40,005	39,489	39,218	39,384	

## ●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)
国庫短期証券	1274	-	35,000	2024/12/10	2025/6/10	83,438	27,754.9	99.847	0.3073%	69.1025%	99.853	0.2952%	7,245

## ●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1年超3年以下)	3,250	2024/12/10			10,303	3,254	▲0.014		▲0.013	23.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/12/10			9,412	3,758	▲0.020		▲0.019	92.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/12/10			1,591	753	▲0.006		▲0.005	65.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/12/9	2024/12/10	▲0.050	6,052	6,052		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/12/9	2024/12/10	▲0.050	0	0				

## ●2024年12月10日の予定

*11月のマネーストック	*5年利付国債入札(23,000億円、12/11発行)	*エネルギー対策借入(7,430億円、12/20借入)
--------------	-----------------------------	-----------------------------

◆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