Central Daily Market Report

2024年11月1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11月1日 需給速報	2024年11月5日 需給予想	2024年11月6日 当社予想
銀行券	200	▲ 200	1,500
財政	▲ 21,500	19,300	1,000
資金過不足	▲ 21,300	19,100	2,500

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	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								
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								
気候変動対応オペ								
E T F 買入								
国債補完供給	▲ 7,700	7,900		7,700				
※ F T F 資金供給用国債補完供給								
当預増減	▲ 21,200		26,800		2,500			

当座預金残高	5,462,400	5,489,200	5,491,700	
準備預金残高	4,909,700			
積み終了先	4,908,900			
超過準備	4,908,900			
非準備預金先	552,700			
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額			4,041,000	
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	64.52%

●短期金融市場関連指標

2024/11/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.221	0.228	0.227				-	0.241
T/N							-	0.240
S/N							-	-
1W			0.390				-	0.203
2W			0.227				-	0.203
3W							-	0.202
1M	0.280	0.420	0.297				-	0.204
3M			0.353				0.012	0.230
6M							0.130	0.289
1Y							0.325	0.339

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)
0.940	+0.005	38,053.67	▲ 1,027.58	151.97-00	152.54-56
日付	10/25	10/28	10/29	10/30	10/31
日銀当預残	5,487,500	5,488,000	5,487,500	5,484,200	5,483,600
準備預金残	4,914,200	4,922,300	4,908,800	4,906,800	4,912,500
マネタリーベース	6,730,200	6,730,900	6,730,400	6,727,400	6,727,100
無担O/N加重平均	0.227%	0.228%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高	112,444	112,695	114,543	114,607	111,457
うち無担	75,127	76,044	77,574	78,109	76,588
うちO/N	27,052	28,249	29,609	29,844	28,453
うち有担	37,317	36,651	36,969	36,498	34,869

●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	1266	-	43,000	2024/11/5	2025/2/10	95,872	33,802.6	99.9960	0.0150%	95.9189%	99.9977	0.0086%	9,197

●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)		2024/11/1	2024/11/5	▲0.050	7,876	7,876		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/1	2024/11/5	▲0.050	0	0				

●2024年11月4日の予定

*振替休日	*9月の米製造業新規受注・出荷・在庫
-------	--------------------

●2024年11月5日の予定

*10月のマネタリーベース *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*9月の米貿易収支 *10月のISM非製造業景況指数
---------------------------------------	-------------------------------

◆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

●2024年11月1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4日積み要因を受け、邦銀業態を中心に資金調達ニーズが一段と強まる展開となった。しかし、レートは既に高水準での推移となっていたことから、出会いの水準に大きな変化は見られず、引き続き0.225~0.227%程度での取引となった。
ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.235~0.245%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>

1日はTB3M物(第1266回)の入札が実施され、引き続き強い水準での決着となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりで推移した。
この他、1Y物でも少額の出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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。