

Central Daily Market Report

2024年11月5日(火)

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5日 需給速報	2024年11月6日 需給予想	2024年11月7日 当社予想
銀行券	▲ 100	400	600
財政	19,000	800	1,000
資金過不足	18,900	1,200	1,600

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						
CP等買入				▲ 500		
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	▲ 8,200	7,700		8,200		

当増減	18,400	8,900	1,600
-----	--------	-------	-------

当座預金残高	5,480,800	5,489,700	5,491,300
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,916,400		
積み終了先	4,915,800		
超過準備	4,915,800		
非準備預金先	564,400		
11月6日以降の残り所要積立額			
積数		900	
1日平均		100	

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	99.98%	日数	67.74%
---------	----	--------	----	--------

●2024年11月5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、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出合いの水準は0.225~0.227%を中心に横這い圏で推移した。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、0.24~0.245%程度での出合いとなった。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>

5日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で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。

●短期金融市場関連指標

2024/11/5	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	売買参考値	平均値
O/N	0.220	0.228	0.227				-	0.238
T/N							-	0.238
S/N							-	-
1W	0.231	0.390	0.288				-	0.204
2W							-	0.204
3W							-	0.204
1M	0.295	0.460	0.331				-	0.207
3M			0.300				0.012	0.239
6M							0.130	0.301
1Y							0.315	0.350

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)
0.930	▲ 0.010	38,474.90	+421.23	152.25-28	152.27-28

日付	10/28	10/29	10/30	10/31	11/1
日銀当預残	5,488,000	5,487,500	5,484,200	5,483,600	5,462,400
準備預金残	4,922,300	4,908,800	4,906,800	4,912,500	4,910,700
マネタリーベース	6,730,900	6,730,400	6,727,400	6,727,100	6,705,700
無担O/N加重平均	0.228%	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	112,695	114,543	114,607	111,457	116,213
うち無担	76,044	77,574	78,109	76,588	79,508
うちO/N	28,249	29,609	29,844	28,453	29,853
うち有担	36,651	36,969	36,498	34,869	36,705

●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
米ドル資金供給		2024/11/7	2024/11/14	4.910	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/5	2024/11/6	▲ 0.050	8,359	8,359		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/5	2024/11/6	▲ 0.050	0	0				

●2024年11月6日の予定

*11月の日銀当座預金増減要因見込み	*米FOMC(1日目)	*交付税特別会計借入(13,000億円、11/15借入)
*金融政策決定会合議事要旨(9月19・20日分)		

◆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ものがあります。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