

Central Daily Market Report

2024年11月6日(水)

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6日 需給速報	2024年11月7日 需給予想	2024年11月8日 当社予想
銀行券	500	▲ 100	600
財政	500	▲ 2,900	▲ 27,000
資金過不足	1,000	▲ 3,000	▲ 26,400

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			8,700			
CP等買入		▲ 500		▲ 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	▲ 9,300	8,200		9,300		

当預増減	▲ 600	14,900	▲ 26,400
------	-------	--------	----------

当座預金残高	5,480,200	5,495,100	5,468,700
準備預金残高	4,911,200		
積み終了先	4,910,800		
超過準備	4,910,700		
非準備預金先	569,000		

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	99.99%	日数	70.97%
---------	----	--------	----	--------

●2024年11月6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、ショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.235~0.24%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>

6日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<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

2024/11/6	無担(速報)			有担(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	0.228	0.227					-	0.240
T/N								-	0.233
S/N								-	-
1W				0.226				-	0.204
2W	0.227	0.280	0.236					-	0.204
3W								-	0.204
1M				0.280				-	0.207
3M				0.390				0.012	0.241
6M								0.150	0.302
1Y								0.325	0.356

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)
0.980	+0.050	39,480.67	+1,005.77	151.43-45	153.93-95

日付	10/29	10/30	10/31	11/1	11/5
日銀当預残	5,487,500	5,484,200	5,483,600	5,462,400	5,480,800
準備預金残	4,908,800	4,906,800	4,912,500	4,910,700	4,916,400
マネタリーベース	6,730,400	6,727,400	6,727,100	6,705,700	6,724,200
無担O/N加重平均	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	114,543	114,607	111,457	116,213	120,080
うち無担	77,574	78,109	76,588	79,508	82,693
うちO/N	29,609	29,844	28,453	29,853	32,818
うち有担	36,969	36,498	34,869	36,705	37,387

●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1非償付額(億円)	非償付額(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/11/15	2025/5/15	64,879	12,990		0.347%	80.0000%		0.331%		10

●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年以下)	1,500	2024/11/7			2,686	1,502	▲0.008		0.016	22.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2024/11/7			10,382	3,255	▲0.007		▲0.004	27.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/11/7			14,987	3,255	▲0.002		0.000	19.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/11/7			1,607	751	▲0.008		▲0.001	20.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/6	2024/11/7	▲0.050	9,552	9,552		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/6	2024/11/7	▲0.050		0				

●2024年11月7日の予定

*9月の毎月勤労統計調査速報	*米FOMC(2日目)	*国庫短期証券(1267回)入札(6ヶ月、35,000億円、11/11発行)
	*英中銀MPC	*10年利付国債入札(26,000億円、11/8発行)
	*9月の米卸売売上高	
	*9月の米消費者信用残高	

◆本資料は信頼できると思わ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ことがあります。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