

Central Daily Market Report

2024年11月7日(木)

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7日 需給速報	2024年11月8日 需給予想	2024年11月11日 当社予想			
銀行券	0	200	1,500			
財政	▲ 3,700	▲ 22,400	11,000			
資金過不足	▲ 3,700	▲ 22,200	12,500			
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
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		▲ 100	▲ 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	▲ 7,900	9,300	7,900			
当預増減	6,300	▲ 14,900	12,500			
当座預金残高	5,486,500	5,471,600	5,484,100			
準備預金残高	4,916,500					
積み終了先	4,916,400			11月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,916,400			積数	300	
非準備預金先	570,000			1日平均	0	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					4,035,500	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	74.19%		

●2024年11月7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%の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%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>

7日はTBGM物(第1267回)の入札が実施され、事前予想に比べしっかりの結果となった。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。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。

●短期金融市場関連指標

2024/11/7	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				-	0.226
T/N							-	0.231
S/N							-	-
1W							-	0.204
2W	0.275	0.280	0.278				-	0.204
3W							-	0.204
1M			0.290				-	0.207
3M							0.012	0.243
6M							0.190	0.308
1Y							0.325	0.359

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)
1.005	+0.025	39,381.41	▲ 99.26	154.30-33	153.99-01
日付	10/30	10/31	11/1	11/5	11/6
日銀当預残	5,484,200	5,483,600	5,462,400	5,480,800	5,480,200
準備預金残	4,906,800	4,912,500	4,910,700	4,916,400	4,912,100
マネタリーベース	6,727,400	6,727,100	6,705,700	6,724,200	6,723,100
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	114,607	111,457	116,213	120,080	119,819
うち無担	78,109	76,588	79,508	82,693	82,931
うちO/N	29,844	28,453	29,853	32,818	33,326
うち有担	36,498	34,869	36,705	37,387	36,888

●入札結果

名称	回数	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非番格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1267	-	35,000	2024/11/11	2025/5/12	86,015	27,677.8	99,900	0.2007%	21.1140%	99.906	0.1886%	7,322	
10年利付国債	376	0.9%	26,000	2024/11/8	2034/9/20	63,761	20,349	99.08	1.002%	66.2276%	99.12	0.997%	5,643	3.22

●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)		2024/11/7	2024/11/8	▲0.050	8,090	8,090		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/7	2024/11/8	▲0.050	0	0				

●2024年11月8日の予定

*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*11月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1268回)入札(3ヶ月、43,000億円、11/11発行)
*9月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.1%)		*エネルギー対策借入(6,308億円、11/20借入)
*9月の特定サービス産業動態統計速報		
*9月の景気動向指数速報		

◆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