

Central Daily Market Report

2024年11月8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8日 需給速報	2024年11月11日 需給予想	2024年11月12日 当社予想		
銀行券	300	500	1,500		
財政	▲ 23,100	1,600	▲ 2,500		
資金過不足	▲ 22,800	2,100	▲ 1,000		
金融調節	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		▲ 600	▲ 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	▲ 7,800	7,900	7,800		
当預増減	▲ 23,300	9,800	▲ 1,000		
当座預金残高	5,463,200	5,473,000	5,472,000		
準備預金残高	4,901,900				
積み終了先	4,901,800			11月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,901,800			積数	200
非準備預金先	561,300			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	100.00%	日数		83.87%

●2024年11月8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%程度で推移した。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、0.235~0.25%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>

8日はTB3M物(第1268回)の入札が実施され、テールが流れる結果となった。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、6M物と1Y物でも出合いが見られた。

<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

2024/11/8	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	売買参考値 平均値
O/N	0.221	0.228	0.227				-	0.164
T/N							-	0.235
S/N							-	-
1W			0.228				-	0.204
2W			0.290				-	0.204
3W							-	0.204
1M			0.370				-	0.208
3M			0.350				0.050	0.246
6M							0.200	0.309
1Y							0.335	0.360

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)
1.000	▲ 0.005	39,500.37	+118.96	153.16-18	152.63-65
日付	10/31	11/1	11/5	11/6	11/7
日銀当預残	5,483,600	5,462,400	5,480,800	5,480,200	5,486,500
準備預金残	4,912,500	4,910,700	4,916,400	4,912,100	4,916,600
マネタリーベース	6,727,100	6,705,700	6,724,200	6,723,100	6,729,400
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	111,457	116,213	120,080	119,819	119,090
うち無担	76,588	79,508	82,693	82,931	81,928
うちO/N	28,453	29,853	32,818	33,326	33,013
うち有担	34,869	36,705	37,387	36,888	37,162

●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	1268	-	43,000	2024/11/11	2025/2/17	80,940	33,663.8	99.9865	0.0502%	61.1525%	99.9931	0.0257%	9,336
エネルギー対策	-	-	6,308	2024/11/20	2025/11/20	33,175	6,308		0.488%	48.5188%		0.484%	

●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	応募総額(億円・百万ドル)	着札総額(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	平均着札レート・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)		2024/11/8	2024/11/11	▲0.050	7,930	7,930		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/8	2024/11/11	▲0.050	14	14		▲0.050	▲0.050	

●2024年11月11日の予定

*決定会合における主な意見(10月30・31日分)	*New York祝日(Veterans Day)	*10年物価連動国債(2,500億円、11/12発行)
*9月の国際収支		
*10月の景気ウォッチャー調査		

◆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