

Central Daily Market Report

2024年11月11日(月)
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11日 需給速報		2024年11月12日 需給予想		2024年11月13日 当社予想					
銀行券	400		200		1,000					
財政	▲ 100		▲ 7,200		▲ 2,000					
資金過不足	300		▲ 7,000		▲ 1,000					
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						▲ 8,000				
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	▲ 5,800	7,800		5,800						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	2,200		▲ 1,200		▲ 9,000					
当座預金残高	5,465,400		5,464,200		5,455,200					
準備預金残高	4,906,700		11月12日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>100</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				積数	100	1日平均	0
積数	100									
1日平均	0									
積み終了先	4,906,600									
超過準備	4,906,600									
非準備預金先	558,700									
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		87.10%					

●2024年11月11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、週末要因が剥落した事によりビッド件数はやや減少したものの、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、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

＜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＞

11日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で少額の出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の発行が観測された。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

2024/11/11	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	0.295	0.227				-	0.243
T/N							-	0.237
S/N							-	-
1W			0.226				-	0.207
2W			0.227				-	0.207
3W			0.380				-	0.207
1M							-	0.209
3M							0.065	0.247
6M							0.200	0.310
1Y							0.335	0.366

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)
0.995	▲ 0.005	39,533.32	+32.95	152.91-94	153.63-65
日付	11/1	11/5	11/6	11/7	11/8
日銀当預残	5,462,400	5,480,800	5,480,200	5,486,500	5,463,200
準備預金残	4,910,700	4,916,400	4,912,100	4,916,600	4,901,900
マネタリーベース	6,705,700	6,724,200	6,723,100	6,729,400	6,705,800
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	116,213	120,080	119,819	119,090	118,090
うち無担	79,508	82,693	82,931	81,928	80,824
うちO/N	29,853	32,818	33,326	33,013	30,414
うち有担	36,705	37,387	36,888	37,162	37,266

●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)
物価連動10年	29	0.005%	2,500	2024/11/12	2034/3/10	8,850	2,498	103.55	▲0.362%	51.0638%			

●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)		2024/11/11	2024/11/12	▲0.050	5,918	5,918		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/11	2024/11/12	▲0.050	0	0				

●2024年11月12日の予定

*10月のマネーストック	*交付税特別会計借入 (13,000億円、11/22借入)
--------------	----------------------------------

◆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