Central Daily Market Report

2024年11月13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13日 需給速報	2024年11月14日 需給予想	2024年11月15日 当社予想			
銀行券	100	▲ 200	▲ 500			
財政	3,500	▲ 9,600	▲ 3,000			
資金過不足	3,600	▲ 9,800	▲ 3,500			
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	8,100	▲ 8,000		▲ 100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,600					
CP等買入		▲ 200				
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	▲ 4,600	5,600		4,600		
当預増減	16,100	▲ 5,300		▲ 3,500		
当座預金残高	5,475,400	5,470,100		5,466,600		
準備預金残高	4,908,800					
積み終了先	4,908,700				11月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,908,700				積数	0
非準備預金先	566,600				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		93.55%

●2024年11月13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%程度を中心に推移した。また、本日は短期金融市場、証券市場、外国為替市場の3市場合同で実施する業務継続計画に関する訓練が実施される中、一部0.275%での出合いも散見されたが市場への影響は限定的であった。
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、0.22~0.23%程度での出合いとなった。
SC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>

13日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2024/11/13	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	0.275	0.228				-	0.240
T/N							-	0.222
S/N							-	-
1W	0.226	0.280	0.235				-	0.207
2W			0.227				-	0.207
3W							-	0.208
1M							-	0.209
3M							0.080	0.253
6M							0.210	0.323
1Y							0.365	0.384

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)
1.040	+0.035	38,721.66	▲ 654.43	154.66-68	155.10-12
日付	11/6	11/7	11/8	11/11	11/12
日銀当預残	5,480,200	5,486,500	5,463,200	5,465,400	5,459,300
準備預金残	4,912,100	4,916,600	4,901,900	4,906,700	4,895,800
マネタリーベース	6,723,100	6,729,400	6,705,800	6,707,600	6,701,400
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	119,819	119,090	118,090	120,201	120,967
うち無担	82,931	81,928	80,824	80,540	80,812
うちO/N	33,326	33,013	30,414	30,390	32,782
うち有担	36,888	37,162	37,266	39,661	40,155

●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非償格競争入札(億円)
30年利付国債	84	2.1%	9,000	2024/11/14	2054/9/20	24,040	6,998	96.80	2.280%	27.5949%	96.95	2.271%	1,995

●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)		2024/11/13	2024/11/14	▲ 0.050	4,728	4,728		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/13	2024/11/14	▲ 0.050	0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2024/11/13	2024/11/14	0.250	54	54				

●2024年11月14日の予定

*10月の米生産者物価指数	*国有林野借入(723億円、11/25借入)
*7-9月期のユーロ圏GDP2次速報	

◆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場合があります。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