

Central Daily Market Report

2024年11月14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14日 需給速報	2024年11月15日 需給予想	2024年11月18日 当社予想
銀行券	▲ 200	0	700
財政	▲ 11,200	700	▲ 22,000
資金過不足	▲ 11,400	700	▲ 21,300

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		▲ 100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入				▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						▲ 100
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 4,800	4,600		4,800		
当預増減	▲ 11,700		5,200		▲ 21,400	

当座預金残高	5,463,700	5,468,900	5,447,500	
準備預金残高	4,903,800			
積み終了先	4,903,800			
超過準備	4,903,800			
非準備預金先	559,900			
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	96.77%

●2024年11月14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。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、0.22~0.195%程度での出会いとなった。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>

14日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出合いが見られた。

<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

2024/11/14	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				-	0.192
T/N							-	0.204
S/N							-	-
1W							-	0.206
2W			0.290				-	0.206
3W							-	0.207
1M	0.290	0.300	0.297				-	0.208
3M							0.130	0.254
6M							0.230	0.335
1Y							0.365	0.390

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)
1.058	+0.018	38,535.70	▲ 185.96	155.40-43	155.83-85
日付	11/7	11/8	11/11	11/12	11/13
日銀当預残	5,486,500	5,463,200	5,465,400	5,459,300	5,475,400
準備預金残	4,916,600	4,901,900	4,906,700	4,895,800	4,909,400
マネタリーベース	6,729,400	6,705,800	6,707,600	6,701,400	6,717,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	119,090	118,090	120,201	120,967	119,065
うち無担	81,928	80,824	80,540	80,812	79,627
うちO/N	33,013	30,414	30,390	32,782	31,127
うち有担	37,162	37,266	39,661	40,155	39,438

●入札結果

名称	国号	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	募入最高利率・利回数	素分率	募入平均価格	募入平均利率・利回数	第1非償債競争入札(億円)
国有林野借入	-	-	723	2024/11/25	2029/11/25	3,619	723		0.775%	46.0000%		0.733%	

●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・利回数差・価格差	全取レート・利回数差・価格差	平均落札レート・利回数差・価格差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/14	2024/11/15	▲0.050	4,943	4,943		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/14	2024/11/15	▲0.050	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第26回	2024/11/18	2025/11/17	0.25%	57

●2024年11月15日の予定

*7-9月期のGDP 1次速報 (市場予想:前年比年率+0.7%)	*10月の米小売売上高	*国庫短期証券(1269回)入札 (3ヶ月、43,000億円、11/18発行)
*9月の第3次産業活動指数	*10月の米鉱工業生産・設備稼働率	*5年利付国債入札 (23,000億円、11/18発行)
	*9月の米企業在庫	
	*7-9月期の英GDP速報値	

◆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