

●資金需給

単位：億円	2024年11月18日 需給速報		2024年11月19日 需給予想		2024年11月20日 当社予想	
銀行券	200		0		▲ 500	
財政	▲ 19,000		2,900		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 18,800		2,900		▲ 4,500	
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			8,100			
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	100	▲ 100				
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 5,900	5,700		5,900		
※ F T L資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 19,000		16,800		▲ 4,500	
当座預金残高	5,443,300		5,460,100		5,455,600	
準備預金残高	4,885,700					
積み終了先	4,856,800		11月19日以降の残り所要積立額 積数 51,200 1日平均 1,900			
超過準備	4,849,100					
非準備預金先	557,600					
積み期間（11/16～12/15）の所要準備額					3,912,200	
準備預金進捗率	実績 98.69%		日数		10.00%	

●2024年11月18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、0.235~0.25%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＞
18日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は大型発行を含め、複数の業態で発行が観測された。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

2024/11/18	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	0.220	0.228	0.227				-	0.240
T/N							-	0.234
S/N							-	-
1W	0.230	0.278	0.270				-	0.208
2W	0.227	0.400	0.243				-	0.208
3W							-	0.208
1M	0.295	0.300	0.298				-	0.212
3M							0.110	0.269
6M							0.235	0.352
1Y							0.379	0.406

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)
1.070	0.000	38,220.85	▲ 422.06	154.64~66	154.56~58

日付	11/11	11/12	11/13	11/14	11/15
日銀当預残	5,465,400	5,459,300	5,475,400	5,463,700	5,462,300
準備預金残	4,906,700	4,895,800	4,909,400	4,903,800	4,905,600
マネタリーベース	6,707,600	6,701,400	6,717,300	6,705,800	6,704,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高	120,201	120,967	119,065	118,291	121,285
うち無担	80,540	80,812	79,627	78,248	79,790
うちO/N	30,390	32,782	31,127	29,898	31,720
うち有担	39,661	40,155	39,438	40,043	41,495

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2024/11/19			9,188	3,256	0.000		0.001	14.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/11/19			6,692	3,758	▲ 0.007		▲ 0.005	59.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/11/19			4,190	1,502	0.001		0.002	94.6
社債等買入	250	2024/11/21			694	250	0.758		0.767	56.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/18	2024/11/19	▲ 0.050	5,932	5,932		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/18	2024/11/19	▲ 0.050	204	204		▲ 0.050	▲ 0.050	

●2024年11月19日の予定

*10月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1270回)入札	*流動性供給入札	*交付税特別会計借入
*10月のユーロ圏消費者物価指数改定値	(1年、32,000億円、11/20発行)	(6,500億円、11/20発行)	(13,000億円、11/27借入)

◆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