

Central Daily Market Report

2024年11月19日（火）
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19日 需給速報		2024年11月20日 需給予想		2024年11月21日 当社予想							
銀行券	▲ 100		▲ 200		▲ 1,000							
財政	2,700		▲ 11,800		▲ 1,000							
資金過不足	2,600		▲ 12,000		▲ 2,000							
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												
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		▲ 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					300							
気候変動対応オペ												
E T F 買入												
国債補完供給	▲ 8,600	5,900		8,600								
※ドル資金供給用担保国債供給												
当預増減	7,900		▲ 3,500		▲ 1,700							
当座預金残高	5,451,200		5,447,700		5,446,000							
準備預金残高	4,891,500		<table><tr><td colspan="2">11月20日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>33,000</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>1,300</td></tr></table>				11月20日以降の残り所要積立額		積数	33,000	1日平均	1,300
11月20日以降の残り所要積立額												
積数	33,000											
1日平均	1,300											
積み終了先	4,875,600											
超過準備	4,873,300											
非準備預金先	559,700											
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	99.16%	日数	13.33%								

●2024年11月19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、0.235～0.245%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＞

19日はTB1Y物（第1270回）の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は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

2024/11/19	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	0.275	0.227				－	0.231
T/N							－	0.238
S/N							－	－
1W	0.268	0.390	0.296				－	0.209
2W							－	0.209
3W							－	0.212
1M			0.340				－	0.213
3M							0.110	0.272
6M							0.235	0.352
1Y							0.435	0.407

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）
1.065	▲ 0.005	38,414.43	+193.58	154.59-62	154.53-54
日付					
11/12		11/13	11/14	11/15	11/18
日銀当預残		5,459,300	5,475,400	5,463,700	5,462,300
準備預金残		4,895,800	4,909,400	4,903,800	4,905,600
マネタリーベース		6,701,400	6,717,300	6,705,800	6,704,300
無担O/N加重平均		0.227%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高		120,967	119,065	118,291	121,285
うち無担		80,812	79,627	78,248	79,790
うちO/N		32,782	31,127	29,898	31,720
うち有担		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・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	1270	－	32,000	2024/11/20	2025/11/20	77,364	24,636.8	99.557	0.4449%	34.5016%	99.564	0.4379%	7,363
流動性供給	417	－	6,500	2024/11/20	－	21,972	6,487		▲0.013%	76.5128%		▲0.015%	
交付税特会	－	－	13,000	2024/11/27	2025/5/27	63,179	13,000.06		0.400%	66.0500%		0.384%	

●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
米ドル資金供給		2024/11/21	2024/11/29	4.830	1	1				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/11/19	2024/11/20	▲0.050	9,011	9,011		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/11/19	2024/11/20	▲0.050	4	4		▲0.050	▲0.050	
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2024/11/20	2024/12/2	0.220	2	2		0.220	0.220	

●2024年11月20日の予定

*10月の貿易統計	*10月の英消費者物価指数
-----------	---------------

◆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ものがあります。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