

Central Daily Market Report

2024年11月20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20日 需給速報	2024年11月21日 需給予想	2024年11月22日 当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 700	▲ 2,000
財政	▲ 10,000	7,300	▲ 12,000
資金過不足	▲ 10,200	6,600	▲ 14,000

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						
CP等買入		▲ 100		▲ 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			300			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 4,700	8,600		4,700		
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減	▲ 6,400		11,400		▲ 14,000	

当座預金残高	5,444,800	5,456,200	5,442,200
準備預金残高	4,877,300		
積み終了先	4,872,800		
超過準備	4,866,500		
非準備預金先	567,500		
11月21日以降の残り所要積立額			
積数		22.200	
1日平均		900	

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 99.43% 日数 16.67%

●短期金融市場関連指標

2024/11/20	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	売買参考統計値	平均値
O/N	0.220	0.275	0.227				-	0.231
T/N			0.275				-	0.238
S/N							-	-
1W	0.226	0.390	0.229				-	0.211
2W			0.270				-	0.211
3W							-	0.212
1M			0.295				-	0.214
3M			0.360				0.105	0.274
6M							0.210	0.352
1Y							0.420	0.411

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	0.000	38,352.34	▲ 62.09	154.71-74	155.65-67

日付	11/13	11/14	11/15	11/18	11/19
日銀当預残	5,475,400	5,463,700	5,462,300	5,443,300	5,451,200
準備預金残	4,909,400	4,903,800	4,905,600	4,886,800	4,893,000
マネタリーベース	6,717,300	6,705,800	6,704,300	6,685,100	6,693,100
無担O/N加重平均	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	119,065	118,291	121,285	116,364	121,372
うち無担	79,627	78,248	79,790	76,931	81,224
うちO/N	31,127	29,898	31,720	28,451	31,974
うち有担	39,438	40,043	41,495	39,433	40,148

●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	応募総額(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)		2024/11/20	2024/11/21	▲0.050	4,790	4,790		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/20	2024/11/21	▲0.050	0	0				

●2024年11月21日の予定

*10月の米中古住宅販売件数	*20年利付国債入札(10,000億円、11/22発行) *交付税特別会計借入(13,000億円、11/29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