

Central Daily Market Report

2024年11月21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21日 需給速報	2024年11月22日 需給予想	2024年11月25日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 500	▲ 300			
財政	4,200	▲ 14,100	17,000			
資金過不足	3,500	▲ 14,600	16,700			
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		▲ 200	▲ 500			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	200					
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 5,300	4,700	5,300			
当預増減	2,900	▲ 9,800	16,700			
当座預金残高	5,447,700	5,437,900	5,454,600			
準備預金残高	4,892,100					
積み終了先	4,889,900			11月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,889,500			積数	19.600	
非準備預金先	555,600			1日平均	800	
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	99.50%	日数	20.00%		

●2024年11月21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、0.22~0.235%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>

21日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<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

2024/11/21	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				-	0.234
T/N							-	0.224
S/N							-	-
1W							-	0.211
2W							-	0.212
3W							-	0.212
1M			0.460				-	0.216
3M							0.110	0.275
6M							0.210	0.354
1Y							0.430	0.415

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)
1.095	+0.030	38,026.17	▲ 326.17	155.26-29	154.89-92
日付	11/14	11/15	11/18	11/19	11/20
日銀当預残	5,463,700	5,462,300	5,443,300	5,451,200	5,444,800
準備預金残	4,903,800	4,905,600	4,886,800	4,893,000	4,877,300
マネタリーベース	6,705,800	6,704,300	6,685,100	6,693,100	6,686,900
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	118,291	121,285	116,364	121,372	119,688
うち無担	78,248	79,790	76,931	81,224	79,610
うちO/N	29,898	31,720	28,451	31,974	31,680
うち有担	40,043	41,495	39,433	40,148	40,078

●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)
20年利付国債	190	1.8%	10,000	2024/11/22	2044/9/20	26,629	7,558	98.45	1.907%	4.2350%	98.58	1.898%	2,433
交付税特会	-	-	13,000	2024/11/29	2025/5/30	57,569	13,000		0.475%	2.5462%		0.411%	

●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)		2024/11/21	2024/11/22	▲0.050	5,424	5,424		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/21	2024/11/22	▲0.050	0	0				

●2024年11月22日の予定

*10月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.2%)	*国庫短期証券(1271回)入札 (3ヶ月、43,000億円、11/25発行)
--	--

◆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