

Central Daily Market Report

2024年11月22日（金）
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22日 需給速報		2024年11月25日 需給予想		2024年11月26日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 400		▲ 500	
財政	▲ 15,100		18,200		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 15,600		17,800		▲ 5,500	
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			11,000			
CP等買入		▲ 500		▲ 300		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 4,800	5,300		4,800		
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減	▲ 15,600		33,300		▲ 5,500	
当座預金残高	5,432,100		5,465,400		5,459,900	
準備預金残高	4,880,000					
積み終了先	4,878,200		11月25日以降の残り所要積立額 積数 13,800 1日平均 700			
超過準備	4,878,100					
非準備預金先	552,100					
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 99.65%		日数 30.00%			

●2024年11月22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、0.235～0.24%程度での出会いとなった。
SCI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＞

22日はTB3M物（第1271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

2024/11/22	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	0.210	0.228	0.227				－	0.223
T/N							－	0.238
S/N							－	－
1W			0.295				－	0.212
2W							－	0.212
3W			0.290				－	0.212
1M							－	0.216
3M			0.350				0.120	0.273
6M							0.210	0.357
1Y							0.455	0.418

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）
1.080	▲ 0.015	38,283.85	+257.68	154.15-18	154.72-74
日付	11/15	11/18	11/19	11/20	11/21
日銀当預残	5,462,300	5,443,300	5,451,200	5,444,800	5,447,700
準備預金残	4,905,600	4,886,800	4,893,000	4,877,300	4,892,200
マネタリーベース	6,704,300	6,685,100	6,693,100	6,686,900	6,690,500
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	121,285	116,364	121,372	119,688	118,745
うち無担	79,790	76,931	81,224	79,610	78,766
うちO/N	31,720	28,451	31,974	31,680	30,046
うち有担	41,495	39,433	40,148	40,078	39,979

●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	1271	－	43,000	2024/11/25	2025/3/3	86,741	32,741.5	99.9640	0.1341%	60.9986%	99.9675	0.1210%	10,258

●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	2024/11/25			7,662	3,256	0.008		0.010	45.3
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,250	2024/11/25			8,126	3,255	0.000		0.003	70.7
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,750	2024/11/25			7,549	3,754	▲0.010		▲0.008	40.5
国債買入（残存期間25年超）	750	2024/11/25			2,158	753	0.008		0.008	92.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/11/22	2024/11/25	▲0.050	4,916	4,916		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/11/22	2024/11/25	▲0.050	0	0				

●2024年11月25日の予定

*9月の景気動向指数改訂状況	*流動性供給入札 （5,000億円、11/26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