

# Central Daily Market Report

2024年11月25日(月)

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25日 需給速報	2024年11月26日 需給予想	2024年11月27日 当社予想			
銀行券	▲ 400	▲ 1,000	▲ 1,000			
財政	11,400	▲ 11,200	▲ 1,000			
資金過不足	11,000	▲ 12,200	▲ 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						▲ 8,000
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		▲ 300	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 4,800	4,800		4,800		
当預増減	21,700	▲ 7,600				▲ 10,000
当座預金残高	5,453,800	5,446,200				5,436,200
準備預金残高	4,907,300					
積み終了先	4,905,700				11月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,905,700				積数	12,200
非準備預金先	546,500				1日平均	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	99.69%	日数			33.33%

## ●2024年11月25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、相場に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズを背景に、0.226~0.227%程度での推移となった。  
ターム物は、証券業態を中心に引き合いが散見された。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.18~0.235%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＞

25日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### ＜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

2024/11/25	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	売買参考値	平均値
O/N	0.220	0.228	0.227				-	0.234
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W	0.231	0.278	0.270				-	0.212
2W	0.227	0.360	0.237				-	0.212
3W							-	0.213
1M							-	0.217
3M			0.420				0.120	0.273
6M							0.210	0.360
1Y							0.460	0.421

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	▲ 0.010	38,780.14	+496.29	154.13-16	154.53-55
日付	11/18	11/19	11/20	11/21	11/22
日銀当預残	5,443,300	5,451,200	5,444,800	5,447,700	5,432,100
準備預金残	4,886,800	4,893,000	4,877,300	4,892,200	4,880,300
マネタリーベース	6,685,100	6,693,100	6,686,900	6,690,500	6,675,400
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	116,364	121,372	119,688	118,745	117,833
うち無担	76,931	81,224	79,610	78,766	77,239
うちO/N	28,451	31,974	31,680	30,046	30,359
うち有担	39,433	40,148	40,078	39,979	40,594

## ●入札結果

名称	回数	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)
流動性供給	418	-	5,000	2024/11/26	-	19,536	4,992		▲0.008%	26.4299%		▲0.009%	

## ●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)		2024/11/25	2024/11/26	▲0.050	4,956	4,956		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/25	2024/11/26	▲0.050	0	0				

## ●2024年11月26日の予定

*月例経済報告	*9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*交付税特別会計借入(13,000億円、12/4借入)
*10月の企業向けサービス価格指数	*10月の米新築一戸建て販売件数	
	*11月の米CB消費者信頼感指数	

◆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