

Central Daily Market Report

2024年11月26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26日 需給速報	2024年11月27日 需給予想	2024年11月28日 当社予想
銀行券	▲ 1,000	▲ 800	▲ 1,000
財政	▲ 13,300	▲ 4,700	▲ 10,000
資金過不足	▲ 14,300	▲ 5,500	▲ 11,000

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	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	▲ 8,000				
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入								
国債買入								
CP等買入		▲ 200		▲ 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	▲ 7,400	4,800		7,400				
当預増減	▲ 17,100		1,600		▲ 11,000			

当座預金残高	5,436,700	5,438,300	5,427,300	
準備預金残高	4,883,800			
積み終了先	4,882,200			
超過準備	4,882,100			
非準備預金先	552,900			
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	99.73%	日数	36.67%

●2024年11月26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、レートは0.226~0.227%程度での推移となった。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、0.14~0.155%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>

26日のアウトラ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。

また本日は、CP等買入オペが事前予定通り2,000億円に減額してオファーされた。結果は、按分レート0.452%、平均レート0.483%と、前回(4,000億円、按分0.345%、平均0.370%)比で按分、平均ともに大きく上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/11/26	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	0.215	0.275	0.228			0.180	-	0.176
T/N							-	0.152
S/N							-	-
1W			0.390				-	0.203
2W			0.380				-	0.206
3W							-	0.209
1M							-	0.216
3M	0.330	0.380	0.338				0.120	0.286
6M							0.210	0.362
1Y							0.460	0.425

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)
1.060	▲ 0.010	38,442.00	▲ 338.14	154.37-40	154.03-04
日付	11/19	11/20	11/21	11/22	11/25
日銀当預残	5,451,200	5,444,800	5,447,700	5,432,100	5,453,800
準備預金残	4,893,000	4,877,300	4,892,200	4,880,300	4,907,700
マネタリーベース	6,693,100	6,686,900	6,690,500	6,675,400	6,697,600
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	121,372	119,688	118,745	117,833	116,330
うち無担	81,224	79,610	78,766	77,239	76,641
うちO/N	31,974	31,680	30,046	30,359	29,961
うち有担	40,148	40,078	39,979	40,594	39,689

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/12/4	2025/6/4	47,938	13,000		0.500%	28.3070%		0.467%	

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
米ドル資金供給		2024/11/29	2024/12/5	4.830	2	2				
CP等買入	2,000	2024/11/29			5,749	1,996	0.452		0.483	66.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/26	2024/11/27	▲0.050	7,329	7,329		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2024/11/27	2024/12/11	0.250	13,308	8,005				60.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/26	2024/11/27	▲0.050	393	393		▲0.050	▲0.050	

●2024年11月27日の予定

*7-9月期の米GDP改定値	*40年利付国債入札(7,000億円、11/28発行)
*10月の米個人所得・消費支出(PCE)	
*10月の米耐久財新規受注	

◆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