

Central Daily Market Report

2024年11月28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28日 需給速報	2024年11月29日 需給予想	2024年12月2日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 500	▲ 500
財政	▲ 8,500	4,500	▲ 14,000
資金過不足	▲ 9,700	4,000	▲ 14,500

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			8,900			
CP等買入		▲ 100	2,000	▲ 1,400		
貸出支援基金(成)						▲ 1,700
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 4,100	5,600		4,100		
当預増減	▲ 8,400		17,400		▲ 16,200	

当座預金残高	5,423,100	5,440,500	5,424,300	
準備預金残高	4,866,300			
積み終了先	4,864,600		11月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,864,600		積数	7,200
非準備預金先	556,800		1日平均	400
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	99.82%	日数	43.33%

●2024年11月28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、0.135~0.245%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>

28日のアウトラ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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。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

2024/11/28	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	0.215	0.275	0.228			0.180	-	0.197
T/N							-	0.145
S/N							-	-
1W	0.228	0.390	0.255				-	0.171
2W							-	0.200
3W			0.285				-	0.208
1M			0.530				-	0.216
3M							0.120	0.304
6M							0.200	0.365
1Y							0.445	0.442

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)
1.050	▲ 0.020	38,349.06	+214.09	151.32-35	151.75-78

日付	11/21	11/22	11/25	11/26	11/27
日銀当預残	5,447,700	5,432,100	5,453,800	5,436,700	5,431,500
準備預金残	4,892,200	4,880,300	4,907,700	4,884,400	4,877,200
マネタリーベース	6,690,500	6,675,400	6,697,600	6,681,400	6,676,900
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%	0.228%
コール市場残高	118,745	117,833	116,330	119,628	118,203
うち無担	78,766	77,239	76,641	79,867	78,693
うちO/N	30,046	30,359	29,961	32,347	31,682
うち有担	39,979	40,594	39,689	39,761	39,510

●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	募入最高利率	案分率	募入平均価格	募入平均利率	第1非償格競争入札(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	応札総額(億円・百万ドル)	着札総額(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	平均着札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/11/29			9,729	3,253	▲0.017		▲0.016	70.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/11/29			9,575	3,756	▲0.019		▲0.017	82.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/11/29			3,229	1,505	▲0.008		▲0.005	5.6
国債買入(物価連動債)	600	2024/11/29			1,555	600	0.180		0.013	55.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/28	2024/11/29	▲0.050	4,273	4,273		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/28	2024/11/29	▲0.050		0				

●2024年11月29日の予定

*11月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.1%)	*11月のシカゴPM景況感指数	*国庫短期証券(1272回)入札 (3ヶ月、43,000億円、12/2発行)
*10月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*11月のユーロ圏消費者物価指数速報	*2年利付国債入札 (26,000億円、12/2発行)
*10月の有効求人倍率(市場予想:1.24倍)		
*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+3.9%)		
*10月の商業動態統計速報 *10月の住宅着工統計 *11月の消費動向調査		

◆本資料は信頼できると思わ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ものがあります。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