

Central Daily Market Report

2024年11月29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29日 需給速報		2024年12月2日 需給予想		2024年12月3日 当社予想					
銀行券	▲ 500		▲ 100		▲ 1,000					
財政	0		▲ 17,000		▲ 15,000					
資金過不足	▲ 500		▲ 17,100		▲ 16,000					
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										
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	2,000	▲ 1,400								
貸出支援基金(成)				▲ 1,500						
貸出支援基金(貸)										
被災地支援										
社債等買入		▲ 200		▲ 300						
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 4,700	4,100		4,700						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	8,200		▲ 14,200		▲ 16,000					
当座預金残高	5,431,300		5,417,100		5,401,100					
準備預金残高	4,867,500		12月2日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>2,400</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>200</td></tr></table>				積数	2,400	1日平均	200
積数	2,400									
1日平均	200									
積み終了先	4,866,400									
超過準備	4,865,900									
非準備預金先	563,800									
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 99.94%		日数		53.33%					

●2024年11月29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、月末要因によりビッドサイドの一部に調達を控える動きが見られたものの、出合いの水準に大きな変化は見られず、引き続き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、0.24~0.25%程度での出合いとなった。
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＞

29日はTB3M物(第1272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は、堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施された。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

2024/11/29	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	0.219	0.228	0.227			0.180	-	0.228
T/N							-	0.240
S/N							-	-
1W	0.268	0.278	0.276				-	0.209
2W							-	0.211
3W			0.295				-	0.218
1M							-	0.228
3M			0.460				0.125	0.308
6M							0.190	0.368
1Y							0.455	0.450

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)
1.049	▲ 0.001	38,208.03	▲ 141.03	151.17-19	149.98-00
日付					
11/22	11/25	11/26	11/27	11/28	
日銀当預残	5,432,100	5,453,800	5,436,700	5,431,500	5,423,100
準備預金残	4,880,300	4,907,700	4,884,400	4,877,200	4,865,700
マネタリーベース	6,675,400	6,697,600	6,681,400	6,676,900	6,669,800
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.228%	0.228%	0.228%
コール市場残高	117,833	116,330	119,628	118,203	117,828
うち無担	77,239	76,641	79,867	78,693	78,863
うちO/N	30,359	29,961	32,347	31,682	31,692
うち有担	40,594	39,689	39,761	39,510	38,965

●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1非償 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
国庫短期証券	1272	-	43,000	2024/12/2	2025/3/10	89,600	32,742	99.9615	0.1434%	20.8000%	99.9659	0.1270%	10,258	
2年利付国債	467	0.6%	26,000	2024/12/2	2026/12/1	71,845	19,794	100.020	0.589%	32.5253%	100.034	0.582%	6,200	1.5

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/29	2024/12/2	▲0.150	4,833	4,833		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/29	2024/12/2	▲0.150	8	8		▲0.150	▲0.150	

●2024年12月2日の予定

*7-9月期の法人企業統計調査季報	*11月のISM製造業景況指数 *10月の米建設支出
-------------------	-------------------------------

◆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