

Central Daily Market Report

2024年11月12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12日 需給速報	2024年11月13日 需給予想	2024年11月14日 当社予想
銀行券	200	100	▲ 300
財政	▲ 6,500	1,300	▲ 9,000
資金過不足	▲ 6,300	1,400	▲ 9,300

金融調節	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			11,600					
CP等買入				▲ 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								
国債補充供給	▲ 5,600	5,800		5,600				
当預増減	▲ 6,100		18,400		▲ 9,300			

当座預金残高	5,459,300	5,477,700	5,468,400	
準備預金残高	4,896,900			
積み終了先	4,896,900			
超過準備	4,896,900			
非準備預金先	562,400			
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額			4,035,500	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.32%

●2024年11月12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、0.18~0.23%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>

12日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2024/11/12	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	売買参考値	平均値
O/N	0.220	0.300	0.227					-	0.215
T/N								-	0.228
S/N								-	-
1W	0.231	0.390	0.281					-	0.207
2W	0.285	0.290	0.286					-	0.207
3W								-	0.207
1M								-	0.208
3M								0.070	0.251
6M								0.205	0.314
1Y								0.335	0.375

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)		
1.005	+0.010	39,376.09	▲ 157.23	153.52-54	153.81-83		
日付	11/5	11/6	11/7	11/8	11/11		
日銀当預残	5,480,800	5,480,200	5,486,500	5,463,200	5,465,400		
準備預金残	4,916,400	4,912,100	4,916,600	4,901,900	4,906,700		
マネタリーベース	6,724,200	6,723,100	6,729,400	6,705,800	6,707,600		
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	120,080	119,819	119,090	118,090	120,201		
うち無担	82,693	82,931	81,928	80,824	80,540		
うちO/N	32,818	33,326	33,013	30,414	30,390		
うち有担	37,387	36,888	37,162	37,266	39,661		

●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)
交付税特会	-	-	13,000	2024/11/22	2025/5/22	65,029	13,000.03		0.375%	75.1800%		0.358%	

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2024/11/13			9,804	3,253	0.003		0.003	95.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/11/13			12,345	3,254	0.007		0.010	34.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/11/13			7,856	3,756	0.004		0.006	69.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/11/13			3,765	1,511	0.008		0.010	32.8
米ドル資金供給		2024/11/14	2024/11/21	4.830	2	2				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/11/12	2024/11/13	▲0.050	5,768	5,768		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2024/11/13	2024/11/27	0.250	13,002	8,006				61.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/12	2024/11/13	▲0.050	0	0				

●2024年11月13日の予定

*10月の企業物価指数	*10月の米消費者物価指数	*30年利付国債入札(9,000億円、11/14発行)
	*10月の米財政収支	

◆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