

# Central Daily Market Report

2024年11月27日(水)

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27日 需給速報	2024年11月28日 需給予想	2024年11月29日 当社予想
銀行券	▲ 800	▲ 1,200	▲ 1,000
財政	▲ 4,000	▲ 8,200	3,000
資金過不足	▲ 4,800	▲ 9,400	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	▲ 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		▲ 300	▲ 100		2,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 7,500	7,400		7,500		
※ F T F資金供給用国債補完供給						
当預増減	▲ 5,200		▲ 2,100			4,000

当座預金残高	5,431,500	5,429,400	5,433,400	
準備預金残高	4,876,700			
積み終了先	4,875,100			
超過準備	4,875,100			
非準備預金先	554,800			
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	99.77%	日数	40.00%

## ●短期金融市場関連指標

2024/11/27	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	0.220	0.275	0.228			0.180	-	0.158
T/N							-	0.150
S/N							-	-
1W			0.226				-	0.181
2W			0.280				-	0.202
3W			0.300				-	0.208
1M							-	0.215
3M			0.490				0.120	0.299
6M							0.225	0.363
1Y							0.475	0.430

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	38,134.97	▲ 307.03	152.93-95	151.94-97
日付	11/20	11/21	11/22	11/25	11/26
日銀当預残	5,444,800	5,447,700	5,432,100	5,453,800	5,436,700
準備預金残	4,877,300	4,892,200	4,880,300	4,907,700	4,884,400
マネタリーベース	6,686,900	6,690,500	6,675,400	6,697,600	6,681,400
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	119,688	118,745	117,833	116,330	119,628
うち無担	79,610	78,766	77,239	76,641	79,867
うちO/N	31,680	30,046	30,359	29,961	32,347
うち有担	40,078	39,979	40,594	39,689	39,761

## ●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)
40年利付国債	17	2.2%	7,000	2024/11/28	2064/3/20	15,646	6,996	91.34	2.550%	71.8181%			

## ●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)		2024/11/27	2024/11/28	▲0.050	7,680	7,680		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/11/27	2024/11/28	▲0.050	11	11		▲0.050	▲0.050	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特則第38期(借り換え)	2024/12/4	2025/12/4	842	13

## ●2024年11月28日の予定

*New York祝日(Thanksgiving Day)
-------------------------------

◆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論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

## ●2024年11月27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、0.15~0.17%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>

27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、月末発行にあたり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。