

# Central Daily Market Report

2021年11月4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	2021年11月4日		2021年11月5日		2021年11月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		600		1,000	
財政	10,000		5,900		▲ 2,000	
資金過不足	9,700		6,500		▲ 1,000	
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	1,000					
国債買入	10,700					
CP等買入				▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 500	200		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	21,100		6,700		▲ 1,000	
当座預金残高	5,371,500		5,378,200		5,377,200	
準備預金残高	4,741,000					
積み終了先	4,741,000		11月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,741,000		積数		100	
非準備預金先	630,500		1日平均		0	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,735,100	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	64.52%		

## ●2021年11月4日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.065~▲0.01%の調達で始まった。引き続き出合いの水準に大きな変化はなく、一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%程度での出合い。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>

4日のアウトラ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市場は複数件の入札が実施された。発行レートは引き続き期越え物で低位横ばい。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/4	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.092	0.075	▲ 0.005	29,794.37	273.47	114.05-07	114.21-22
T/N	▲ 0.048	▲ 0.020	▲ 0.035				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.096						
2W			▲ 0.008				-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.100						
1M	▲ 0.005	0.000	▲ 0.002				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.118	▲ 0.113						
6M							▲ 0.112	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.113	▲ 0.131						
									日付	10/27	10/28	10/29	11/1	11/2
									日銀当預残	5,413,900	5,424,100	5,416,200	5,393,300	5,350,400
									準備預金残	4,767,000	4,770,900	4,777,600	4,746,100	4,710,900
									マネタリーベース	6,636,100	6,647,900	6,640,300	6,617,500	6,574,900
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.027%	▲0.027%	▲0.029%	▲0.031%
									コール市場残高	186,509	188,424	183,069	179,544	174,778
									うち無担	169,503	171,341	166,287	162,181	156,612
									うちO/N	88,033	88,521	86,197	82,441	79,229
									うち有担	17,006	17,083	16,782	17,363	18,166

## ●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非価格競争入札(億円)
物価連動10年	26	0.005%	2,000	2021/11/5	2031/3/10	6,619.0	1,997.00	103.5000	▲0.3570%	23.9819%			

## ●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)		2021/11/4	2021/11/5	▲ 0.350	439	439		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/4	2021/11/5	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年11月5日の予定

*9月の全世帯家計調査 市場予想：消費支出、前年比▲3.9%	*米国10月の雇用統計 *米国9月の消費者信用残高	*国庫短期証券(1035回)入札 (3ヶ月、43,000億円、11/8発行)
-----------------------------------	------------------------------	---

◆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お客様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