

# Central Daily Market Report

2021年11月5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	2021年11月5日		2021年11月8日		2021年11月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		900			0
財政	3,900		2,900			1,000
資金過不足	4,500		3,800			1,000
<b>金融調節</b>	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						
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
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	▲ 800	500		800		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	3,900		4,500			1,000
当座預金残高	5,375,400		5,379,900			5,380,900
準備預金残高	4,736,200					
積み終了先	4,736,200				11月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,736,200				積数	100
非準備預金先	639,200				1日平均	0
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額						3,741,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%		

## ●2021年11月5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。週末を迎えたがレート水準に大きな変化はみられず、一巡後も朝方と同水準の出合いが数件見られ、今週の取引を終えた。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>

5日はTB3M物(1035回)の入札が実施された。今回から発行額が減額となることや、次回入札の3M物の償還日がNY祝日と重なることなどから、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。

### <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低位横ばい。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/5	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.094	0.060	▲ 0.015	29,611.57	▲ 182.80	113.82-83	113.76-77
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	0.000	▲ 0.004				-	▲ 0.095						
2W							-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.101						
1M	▲ 0.022	▲ 0.003	▲ 0.013				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.125	▲ 0.113						
6M							▲ 0.112	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.113	▲ 0.131						
									日付	10/28	10/29	11/1	11/2	11/4
									日銀当預残	5,424,100	5,416,200	5,393,300	5,350,400	5,371,500
									準備預金残	4,770,900	4,777,600	4,746,100	4,710,900	4,741,100
									マネタリーベース	6,647,900	6,640,300	6,617,500	6,574,900	6,596,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.027%	▲ 0.027%	▲ 0.029%	▲ 0.031%	▲ 0.033%
									コール市場残高	188,424	183,069	179,544	174,778	170,694
									うち無担	171,341	166,287	162,181	156,612	152,264
									うちO/N	88,521	86,197	82,441	79,229	75,641
									うち有担	17,083	16,782	17,363	18,166	18,430

## ●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)
国庫短期証券	1035	-	43,000	2021/11/8	2022/2/14	160,989.0	34,980.3	100.0315	▲0.1172%	24.9513%	100.0326	▲0.1213%	8,019.0

## ●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)		2021/11/5	2021/11/8	▲ 0.350	775	775		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/5	2021/11/8	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/11/10			2,190	1,251	▲ 0.055		▲ 0.043	75.4

## ●2021年11月8日の予定

- \*決定会合における主な意見(10月27・28日分)
- \*9月の景気動向指数速報
- \*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引

◆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