

# Central Daily Market Report

2021年11月8日(月)  
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8日		2021年11月9日		2021年11月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		800		1,000	
財政	600		▲ 500		▲ 12,000	
資金過不足	1,500		300		▲ 11,000	
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						▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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					1,300	
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 300	800		300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	1,900		500		▲ 12,100	
当座預金残高	5,377,300		5,377,800		5,365,700	
準備預金残高	4,751,900					
積み終了先	4,751,900				11月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,751,900				積数	100
非準備預金先	625,400				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	77.42%		

## ●2021年11月8日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.08~▲0.001%と幅広いレンジでの調達で始まった。先週比でレート水準は下降し、一巡後は▲0.07~▲0.04%程度の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いがあった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.085%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>

8日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、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。発行レートは横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	
	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)	為替(17時)
単位:%									0.055	▲ 0.005	29,507.05	▲ 104.52	113.47-48	113.56-57
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.091						
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.017				-	▲ 0.098						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.099						
1M	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.016				-	▲ 0.103						
3M								▲ 0.125						
6M								▲ 0.112						
1Y								▲ 0.113						
									日付	10/29	11/1	11/2	11/4	11/5
									日銀当預残	5,416,200	5,393,300	5,350,400	5,371,500	5,375,400
									準備預金残	4,777,600	4,746,100	4,710,900	4,741,100	4,736,200
									マネタリーベース	6,640,300	6,617,500	6,574,900	6,596,300	6,599,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.027%	▲ 0.029%	▲ 0.031%	▲ 0.033%	▲ 0.036%
									コール市場残高	183,069	179,544	174,778	170,694	174,518
									うち無担	166,287	162,181	156,612	152,264	156,672
									うちO/N	86,197	82,441	79,229	75,641	73,449
									うち有担	16,782	17,363	18,166	18,430	17,846

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/8	2021/11/9	▲ 0.350	264	264		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/8	2021/11/9	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年11月9日の予定

*9月の毎月勤労統計調査速報	*米国10月の生産者物価指数	*国庫短期証券(1036回)入札 (6ヶ月、34,500億円、11/10発行)
*9月の国際収支		*30年利付国債入札 (9,000億円、11/10発行)
*9月の特定サービス産業動態統計速報		*交付税特別会計借入 (11,000億円、11/18借入)
*10月の景気ウォッチャー調査		

◆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