

# Central Daily Market Report

2021年11月9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	2021年11月9日		2021年11月10日		2021年11月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		700		0	
財政	▲ 900		▲ 13,700		▲ 1,000	
資金過不足	0		▲ 13,000		▲ 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			2,500	▲ 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		▲ 600		
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			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	0		▲ 12,000		▲ 1,000	
当座預金残高	5,377,300		5,365,300		5,364,300	
準備預金残高	4,764,500					
積み終了先	4,764,500				11月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,764,500				積数	0
非準備預金先	612,800				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	80.65%		

## ●2021年11月9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▲0.087～▲0.001%での調達で始まった。積み目途のついた先も多く、レート水準は前日比でさらに低下した。一巡後は▲0.07～▲0.04%程度の出合いが見られた。ターム物に関しては、ショートタームで引き合いが散見された。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.090～▲0.080%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＞

9日はTB6M物(1036回)の入札が実施された。3M物の発行額が減少したことも意識されてか、ややしっかりめの結果となった。結果発表後のセカンダリマーケットでは、やや堅調に推移した。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/9	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.085	0.060	0.005	29,285.46	▲ 221.59	113.25-26	112.84-86
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.098						
1M				0.150			-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.125	▲ 0.113						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.113	▲ 0.130						
									日付	11/1	11/2	11/4	11/5	11/8
									日銀当預残	5,393,300	5,350,400	5,371,500	5,375,400	5,377,300
									準備預金残	4,746,100	4,710,900	4,741,100	4,736,200	4,752,200
									マネタリーベース	6,617,500	6,574,900	6,596,300	6,599,600	6,600,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.031%	▲ 0.033%	▲ 0.036%	▲ 0.045%
									コール市場残高	179,544	174,778	170,694	174,518	169,348
									うち無担	162,181	156,612	152,264	156,672	151,532
									うちO/N	82,441	79,229	75,641	73,449	69,774
									うち有担	17,363	18,166	18,430	17,846	17,816

## ●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1036	-	34,500	2021/11/10	2022/5/10	106,121.0	28,188.5	100.0560	▲0.1128%	21.0665%	100.0580	▲0.1168%	6,311	
30年利付国債	72	0.700%	9,000	2021/11/10	2051/9/20	25,053.0	7,264.0	100.3500	0.6850%	24.8033%	100.4200	0.6830%	1,722	
交付税特会	-	-	11,000	2021/11/18	2022/5/18	493,109.0	10,990.05		0.0000%	2.2288%		0.0000%		10.0

## ●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	入札総額(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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/11/10	2021/11/24		2,451	2,451				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/9	2021/11/10	▲ 0.350	144	144		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/9	2021/11/10	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/11/12	2021/11/18	0.330	0	0				

## ●2021年11月10日の予定

\*10月のマネーストック

\*米国9月の卸売売上高  
\*米国10月の財政収支  
\*米国10月の消費者物価指数

◆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