Central Daily Market Report

2021年11月10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	2021年11月10日 需給速報	2021年11月11日 需給予想	2021年11月12日 当社予想
銀行券	700	▲ 200	0
財政	▲ 14,400	400	▲ 3,000
資金過不足	▲ 13,700	200	▲ 3,000

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	2,500	▲ 2,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,400			
CP等買入		▲ 600		▲ 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					
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 12,800		13,600		▲ 3,000	

当座預金残高	5,364,500	5,378,100	5,375,100
準備預金残高	4,755,000		
積み終了先	4,755,000	11月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,755,000	積数	0
非準備預金先	609,500	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	83.87%

●2021年11月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き全体的なビッド状況にあまり変化がなく、昨日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀を中心に▲0.085～▲0.001%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.065～▲0.04%程度の出合いで推移した。ターム物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>

10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発行市場は、小口案件中心で案件も少なく、閑散とした展開に終始した。

●短期金融市場関連指標

2021/11/10	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.049				－	▲ 0.083
T/N			▲ 0.060				－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W			0.050				－	▲ 0.090
2W	▲ 0.049	▲ 0.009	▲ 0.038				－	▲ 0.094
3W	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.002				－	▲ 0.098
1M	▲ 0.028	▲ 0.005	▲ 0.015				－	▲ 0.101
3M							▲ 0.125	▲ 0.114
6M							▲ 0.120	▲ 0.120
1Y							▲ 0.113	▲ 0.130

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)
0.055	▲ 0.005	29,106.78	▲ 178.68	112.91-92	113.09-10

日付	11/2	11/4	11/5	11/8	11/9
日銀当預残	5,350,400	5,371,500	5,375,400	5,377,300	5,377,300
準備預金残	4,710,900	4,741,100	4,736,200	4,752,200	4,764,800
マネタリーベース	6,574,900	6,596,300	6,599,600	6,600,500	6,599,600
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.033%	▲0.036%	▲0.045%	▲0.051%
コール市場残高	174,778	170,694	174,518	169,348	160,650
うち無担	156,612	152,264	156,672	151,532	142,751
うちO/N	79,229	75,641	73,449	69,774	61,093
うち有担	18,166	18,430	17,846	17,816	17,899

●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Ｉ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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,500	2021/11/11			12,749	4,511	0.000		0.001	82.8
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,500	2021/11/11			12,610	4,505	▲0.004		▲0.003	14.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,250	2021/11/11			10,016	4,260	▲0.006		▲0.005	54.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/11/10	2021/11/11	▲ 0.350	93	93		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/11/10	2021/11/11	▲ 0.350	0	0				

●2021年11月11日の予定

*10月の企業物価指数
*New York祝日(Veterans Day)
*英国7-9月期のGDP速報値
*流動性供給入札（5,000億円、11/12発行）
*エネルギー対策借入（6,500億円、11/22借入）

◆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