

Central Daily Market Report

2021年11月11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11日		2021年11月12日		2021年11月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		300		1,000	
財政	1,100		▲ 4,700		5,000	
資金過不足	800		▲ 4,400		6,000	
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	13,400					
CP等買入		▲ 100		▲ 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	▲ 200	100		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	14,000		▲ 3,500		6,000	
当座預金残高	5,378,500		5,375,000		5,381,000	
準備預金残高	4,762,200					
積み終了先	4,762,200		11月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,762,200		積数		0	
非準備預金先	616,300		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	87.10%		

●2021年11月11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▲0.085~▲0.001%と幅広いレンジの調達で始まった。レート水準は昨日と横ばい圏で推移したものの、一部では取り上がる動きも見られた。一巡後は▲0.06~▲0.04%程度の出合いが散見された。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.080~▲0.090%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>

11日は短国買入オベが前回と同額(1,000億円)でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、カレント銘柄では特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。発行レートは横ばい圏で推移した。また、CP等買入オベが5,000億円オファーされ、按分落札レート▲0.015%、平均落札レート▲0.013%の結果であった。

●短期金融市場関連指標

2021/11/11	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.084	0.065	0.010	29,277.86	171.08	113.90-91	114.07-09
T/N	▲ 0.060	▲ 0.009	▲ 0.042				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.002	0.000	▲ 0.001				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.099						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.125	▲ 0.114						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.130						
									日付	11/4	11/5	11/8	11/9	11/10
									日銀当預残	5,371,500	5,375,400	5,377,300	5,377,300	5,364,500
									準備預金残	4,741,100	4,736,200	4,752,200	4,764,800	4,755,000
									マネタリーベース	6,596,300	6,599,600	6,600,500	6,599,600	6,586,200
									無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.036%	▲0.045%	▲0.051%	▲0.049%
									コール市場残高	170,694	174,518	169,348	160,650	170,012
									うち無担	152,264	156,672	151,532	142,751	151,154
									うちO/N	75,641	73,449	69,774	61,093	68,626
									うち有担	18,430	17,846	17,816	17,899	18,858

●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)
流動性供給	345	-	5,000	2021/11/12		15,841.0	4,988.0		0.0130%	70.8029%		0.0110%	
エネルギー対策	-	-	6,500	2021/11/22	2022/11/21	222,138.0	6,499.75		0.0000%	2.9261%		0.0000%	

●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
国庫短期証券買入	1,000	2021/11/12			5,795	1,000		0.004	0.004	
CP等買入	5,000	2021/11/16			8,783	4,973	▲0.015		▲0.013	71.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/11	2021/11/12	▲ 0.350	204	204		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/11	2021/11/12	▲ 0.350	0	0				

●2021年11月12日の予定

*11月のミシガン大消費者信頼感指数速報

*国庫短期証券(1037回)入札
(3ヶ月、43,000億円、11/15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