

Central Daily Market Report

2021年11月12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12日		2021年11月15日		2021年11月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		400		0	
財政	▲ 6,100		6,800		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 5,900		7,200		▲ 2,000	
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 800	5,000	
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				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 5,000		6,400		3,000	
当座預金残高	5,373,500		5,379,900		5,382,900	
準備預金残高	4,774,500					
積み終了先	4,774,500		11月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,774,500		積数		0	
非準備預金先	599,000		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	96.77%		

●2021年11月12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。積み最終日を間近に控え、着地に向けた調整で取り上がる動きが見られたため、レート水準は一部で上昇した。一巡後は▲0.05～▲0.035%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、▲0.090～▲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＞

12日はTB3M物(1037回)の入札が実施され、償還日はNY祝日と重なるものの、発行減額が意識されてか、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンドリーマーケットではショートカバーの動きも見られ、強含んで推移した。その他の銘柄では、6M物に出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態から大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/11/12	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.083	0.070	0.005	29,609.97	332.11	114.04-05	114.04-06
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.100						
1M	▲ 0.009	0.010	▲ 0.002				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.140	▲ 0.114						
6M							▲ 0.133	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.130						
									日付	11/5	11/8	11/9	11/10	11/11
									日銀当預残	5,375,400	5,377,300	5,377,300	5,364,500	5,378,500
									準備預金残	4,736,200	4,752,200	4,764,800	4,755,000	4,762,200
									マネタリーベース	6,599,600	6,600,500	6,599,600	6,586,200	6,600,500
									無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.045%	▲0.051%	▲0.049%	▲0.047%
									コール市場残高	174,518	169,348	160,650	170,012	160,459
									うち無担	156,672	151,532	142,751	151,154	141,261
									うちO/N	73,449	69,774	61,093	68,626	67,083
									うち有担	17,846	17,816	17,899	18,858	19,198

●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	1037	-	43,000	2021/11/15	2022/2/21	174,036.0	34,980.7	100.0325	▲0.1210%	51.3350%	100.0333	▲0.1239%	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)		2021/11/12	2021/11/15	▲ 0.350	19	19		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/12	2021/11/15	▲ 0.350	0	0				

●2021年11月15日の予定

*7-9月期のGDP1次速報(市場予想：前年比上年率▲0.8%)

◆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