

# Central Daily Market Report

2021年11月15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15日		2021年11月16日		2021年11月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		600		0	
財政	7,600		1,600		▲ 28,000	
資金過不足	8,000		2,200		▲ 28,000	
<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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 800	5,000	▲ 200		
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	▲ 900			900		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	6,300		7,900		▲ 28,000	
当座預金残高	5,379,800		5,387,700		5,359,700	
準備預金残高	4,813,900					
積み終了先	4,813,900					
超過準備	4,813,900					
非準備預金先	565,900					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,633,000	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2021年11月15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・証券を中心に▲0.075~▲0.001%の出会いが見られた。積み最終の着地に向けた調整から徐々にレートが上昇していく展開となった。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.095%程度での出会い。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>

15日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、6M物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は、入札件数が少なかった。発行レートは、銘柄により目線がまちまちで閑散としていた。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/15	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	
	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.085	0.064	▲ 0.006	29,776.80	166.83	113.98-00	113.94-95
T/N			▲ 0.035				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.050	0.010	▲ 0.029				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.105						
3M			0.005				▲ 0.140	▲ 0.113						
6M							▲ 0.135	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.131						
									日付	11/8	11/9	11/10	11/11	11/12
									日銀当預残	5,377,300	5,377,300	5,364,500	5,378,500	5,373,500
									準備預金残	4,752,200	4,764,800	4,755,000	4,762,200	4,775,000
									マネタリーベース	6,600,500	6,599,600	6,586,200	6,600,500	6,595,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.045%	▲ 0.051%	▲ 0.049%	▲ 0.047%	▲ 0.038%
									コール市場残高	169,348	160,650	170,012	160,459	165,252
									うち無担	151,532	142,751	151,154	141,261	146,944
									うちO/N	69,774	61,093	68,626	67,083	72,866
									うち有担	17,816	17,899	18,858	19,198	18,308

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/15	2021/11/16	▲ 0.350	887	887		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/15	2021/11/16	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年11月16日の予定

*9月の第3次産業活動指数	*米国9月の企業在庫 *米国10月の小売売上高 *米国10月の鉱工業生産・設備稼働率 *ユーロ圏7-9月期のGDP2次速報	*5年利付国債入札(25,000億円、11/17発行) *国有林野借入(830億円、11/25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