Central Daily Market Report

2021年11月16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16日 需給速報		2021年11月17日 需給予想		2021年11月18日 当社予想	
銀行券	600		▲ 200		▲ 1,000	
財政	1,000		▲ 30,800		1,000	
資金過不足	1,600		▲ 31,000		0	
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	5,000	▲ 200		▲ 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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	900		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	7,000		▲ 29,900		0	

当座預金残高	5,386,800	5,356,900	5,356,900
準備預金残高	4,746,100		
積み終了先	3,529,600		
超過準備	1,446,900		
非準備預金先	640,700		

11月17日以降の残り所要積立額	
積数	333,800
1日平均	11,500

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 90.81%	日数	3.33%

●2021年11月16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▲0.083～▲0.001%の出合いが見られた。新積み期の基準比率が9%に設定され、運用ニーズの増加が予想される中、引き続き地銀の調達ニーズが堅調なこともあり、レート水準の大幅な低下には至らなかった。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～▲0.09%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>

16日は短国買入オペが前回と同額(1,000億円)オファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、大型発行が実施されたものの件数が少なく閑散であった。発行レートは、プラス圏の銘柄において低下して推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/11/16	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	▲ 0.037				－	▲ 0.094
T/N	▲ 0.060	▲ 0.040	▲ 0.053				－	▲ 0.100
S/N							－	－
1W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.009				－	▲ 0.101
2W	▲ 0.045	▲ 0.001	▲ 0.030				－	▲ 0.101
3W			▲ 0.020				－	▲ 0.103
1M	▲ 0.020	0.011	▲ 0.006				－	▲ 0.104
3M							▲ 0.140	▲ 0.114
6M							▲ 0.135	▲ 0.122
1Y							▲ 0.133	▲ 0.131

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）
0.070	0.006	29,808.12	31.32	114.12-14	114.26-28

日付	11/9	11/10	11/11	11/12	11/15
日銀当預残	5,377,300	5,364,500	5,378,500	5,373,500	5,379,800
準備預金残	4,764,800	4,755,000	4,762,200	4,775,000	4,813,900
マネタリーベース	6,599,600	6,586,200	6,600,500	6,595,400	6,601,300
無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.049%	▲0.047%	▲0.038%	▲0.030%
コール市場残高	160,650	170,012	160,459	165,252	153,810
うち無担	142,751	151,154	141,261	146,944	135,176
うちO/N	61,093	68,626	67,083	72,866	63,898
うち有担	17,899	18,858	19,198	18,308	18,634

●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非価格競争入札(億円)
5年利付国債	149	0.005%	25,000	2021/11/17	2026/9/20	91,791.0	20,231.0	100.3900	▲0.0750%	39.9856%	100.4000	▲0.0770%	4,751.0
国有林野借入	－	－	830	2021/11/25	2026/11/25	5,151.0	830.00		0.0000%	25.0000%		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	2021/11/17			6,336	1,000	0.008		0.009	33.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/11/16	2021/11/17	▲ 0.350	292	292		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/11/16	2021/11/17	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/11/18	2021/11/26	0.330	1	1				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2021/11/17	2021/11/29		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2021年11月17日の予定

*9月の機械受注統計（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比＋1.8%）
*9月の石油等消費動態統計
*10月の貿易統計
*米国10月の住宅着工件数
*ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値
*英国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