

Central Daily Market Report

2021年11月17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17日		2021年11月18日		2021年11月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 30,400		1,800		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 30,600		700		▲ 9,000	
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	100			▲ 100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			9,300			
CP等買入		▲ 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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 500	300		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 29,900		10,200		▲ 9,000	
当座預金残高	5,356,900		5,367,100		5,358,100	
準備預金残高	4,715,300					
積み終了先	4,699,600					
超過準備	4,393,400					
非準備預金先	641,600					
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	99.68%	日数	6.67%		

●2021年11月17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▲0.080~▲0.001%の出合いが見られた。引き続き地銀の調達ニーズが強く、地合いに大きな変化は見られなかった。その他、3市場合同訓練に伴って、0.001%の出合いが少額見られた。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。本日は3市場合同BCP共同訓練の一環として、固定金利方式による共通担保資金供給オペ(O/N物)が1,000億円オファーされ、55億円の落札となった。

<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>

17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市場は、複数の銘柄で入札が実施された。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/11/17	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.037				-	▲ 0.094	0.070	0.000	29,688.33	▲ 119.79	114.90-91	114.88-90
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	0.050	0.005				-	▲ 0.100						
2W	▲ 0.022	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.140	▲ 0.114						
6M							▲ 0.135	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.131						
									日付	11/10	11/11	11/12	11/15	11/16
									日銀当預残	5,364,500	5,378,500	5,373,500	5,379,800	5,386,800
									準備預金残	4,755,000	4,762,200	4,775,000	4,813,900	4,746,400
									マネタリーベース	6,586,200	6,600,500	6,595,400	6,601,300	6,607,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.049%	▲ 0.047%	▲ 0.038%	▲ 0.030%	▲ 0.037%
									コール市場残高	170,012	160,459	165,252	153,810	192,452
									うち無担	151,154	141,261	146,944	135,176	174,838
									うちO/N	68,626	67,083	72,866	63,898	97,320
									うち有担	18,858	19,198	18,308	18,634	17,614

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/11/18			13,623	4,504	▲0.002		▲0.002	96.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/11/18			7,816	4,256	0.001		0.002	36.4
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/11/18			2,091	504	0.012		0.013	34.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/17	2021/11/18	▲ 0.350	411	411		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/17	2021/11/18	▲ 0.350	0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉・即日	1,000	2021/11/17	2021/11/18		55	55				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第14回	2021/11/19	2023/11/17	0

●2021年11月18日の予定

*国庫短期証券(1038回)入札 (1年、35,000億円、11/22発行)	*20年利付国債入札 (12,000億円、11/19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