

Central Daily Market Report

2021年11月18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18日		2021年11月19日		2021年11月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 400		0	
財政	2,000		▲ 4,900		▲ 9,000	
資金過不足	800		▲ 5,300		▲ 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				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,300					
CP等買入		▲ 200		▲ 1,000		
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				▲ 100		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	500		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	10,200		▲ 6,300		▲ 9,000	
当座預金残高	5,367,100		5,360,800		5,351,800	
準備預金残高	4,724,300					
積み終了先	4,722,900				11月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,719,100				積数 6,600	
非準備預金先	642,800				1日平均 200	
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	99.82%	日数	10.00%		

●2021年11月18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。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、▲0.105～▲0.095%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＞

18日はTB1Y物(1038回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP市場は、大型発行を含めて入札が複数実施された。発行レートは、引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/11/18	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.097	0.080	0.010	29,598.66	▲ 89.67	114.19-20	114.01-03
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.102						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.002	▲ 0.024				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.104						
1M	▲ 0.020	0.150	0.011				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.140	▲ 0.115						
6M							▲ 0.132	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.131						
									日付	11/11	11/12	11/15	11/16	11/17
									日銀当預残	5,378,500	5,373,500	5,379,800	5,386,800	5,356,900
									準備預金残	4,762,200	4,775,000	4,813,900	4,746,400	4,715,300
									マネタリーベース	6,600,500	6,595,400	6,601,300	6,607,700	6,578,000
									無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.038%	▲0.030%	▲0.037%	▲0.037%
									コール市場残高	160,459	165,252	153,810	192,452	194,937
									うち無担	141,261	146,944	135,176	174,838	176,711
									うちO/N	67,083	72,866	63,898	97,320	95,743
									うち有担	19,198	18,308	18,634	17,614	18,226

●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	1038	-	35,000	2021/11/22	2022/11/21	107,479.0	28,478.6	100.1240	▲0.1241%	33.2848%	100.1260	▲0.1261%	6,521.0
20年利付国債	178	0.500%	12,000	2021/11/19	2041/9/20	36,298.0	9,600.00	100.6000	0.4660%	23.9612%	100.6400	0.4640%	2,390.0

●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)		2021/11/18	2021/11/19	▲ 0.350	120	120		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/18	2021/11/19	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2021/11/24			2,119	752	0.113		0.121	4.7

●2021年11月19日の予定

*10月の全国消費者物価指数(GPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.1%	*国庫短期証券(1039回)入札 (3ヶ月、43,000億円、11/22発行)	*交付税特別会計借入 (11,000億円、11/30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