

# Central Daily Market Report

2021年11月19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19日		2021年11月22日		2021年11月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 800		0	
財政	▲ 6,200		▲ 7,500		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 6,700		▲ 8,300		▲ 5,000	
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						▲ 2,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 1,000		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						800
新型コロナウイルス対応金融支援特別		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 7,700		▲ 8,900		▲ 6,700	
当座預金残高	5,359,400		5,350,500		5,343,800	
準備預金残高	4,709,200					
積み終了先	4,708,700		11月22日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,708,400		積数		4,200	
非準備預金先	650,200		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	99.88%	日数	20.00%		

## ●2021年11月19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▲0.078～▲0.001%の出合いが見られた。3日積みであったが積み期序盤のため、取り急ぎ動きは見られず、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＞

19日はTB3M物(1039回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、ショートカバーの動きも見られ、強含んで推移した。この他、1Yカレント銘柄にも出合いが見られた。

### ＜CP市場＞

CP市場は、大型発行を含めて複数件の入札が実施された。発行レートは、銘柄により目線がまちまちであるものの、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/19	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.098	0.075	▲ 0.005	29,745.87	147.21	114.28-29	114.36-37
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.104						
3W			0.180				-	▲ 0.104						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.155	▲ 0.116						
6M							▲ 0.132	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.134	▲ 0.130						
									日付	11/12	11/15	11/16	11/17	11/18
									日銀当預残	5,373,500	5,379,800	5,386,800	5,356,900	5,367,100
									準備預金残	4,775,000	4,813,900	4,746,400	4,715,300	4,724,300
									マネタリーベース	6,595,400	6,601,300	6,607,700	6,578,000	6,589,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.030%	▲ 0.037%	▲ 0.037%	▲ 0.038%
									コール市場残高	165,252	153,810	192,452	194,937	189,807
									うち無担	146,944	135,176	174,838	176,711	172,653
									うちO/N	72,866	63,898	97,320	95,743	91,415
									うち有担	18,308	18,634	17,614	18,226	17,154

## ●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1039	-	43,000	2021/11/22	2022/2/28	171,948.0	34,980.9	100.0370	▲0.1377%	76.3172%	100.0373	▲0.1388%	8,019	
交付税特会	-	-	11,000	2021/11/30	2022/5/31	484,797.0	10,990.28		0.0000%	2.2670%		0.0000%		10.0

## ●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)		2021/11/19	2021/11/22	▲ 0.350	39	39		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/19	2021/11/22	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年11月22日の予定

*流動性供給入札 (4,000億円、11/24発行)	*米国10月の中古住宅販売
-------------------------------	---------------

◆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