

# Central Daily Market Report

2021年11月22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22日		2021年11月24日		2021年11月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 8,300		▲ 5,400		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 9,100		▲ 5,800		▲ 4,000	
<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			2,600	▲ 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		▲ 600		▲ 300		
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	▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給						
米ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 9,700		▲ 5,300		▲ 4,000	
当座預金残高	5,349,700		5,344,400		5,340,400	
準備預金残高	4,706,600					
積み終了先	4,706,200		11月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,706,100		積数		3,200	
非準備預金先	643,100		1日平均		100	
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	99.91%	日数	26.67%		

## ●2021年11月22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~▲0.005%の出合いが見られた。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <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>

22日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施された。発行レートは引き続き横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/11/22	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.102	0.070	▲ 0.005	29,774.11	28.24	114.14-15	114.21-23
T/N			▲ 0.045				-	▲ 0.104						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.105						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.155	▲ 0.115						
6M							▲ 0.132	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.131						
									日付	11/15	11/16	11/17	11/18	11/19
									日銀当預残	5,379,800	5,386,800	5,356,900	5,367,100	5,359,400
									準備預金残	4,813,900	4,746,400	4,715,300	4,724,300	4,709,300
									マネタリーベース	6,601,300	6,607,700	6,578,000	6,589,300	6,582,200
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.038%	▲0.037%
									コール市場残高	153,810	192,452	194,937	189,807	194,101
									うち無担	135,176	174,838	176,711	172,653	176,890
									うちO/N	63,898	97,320	95,743	91,415	97,617
									うち有担	18,634	17,614	18,226	17,154	17,211

## ●入札結果

名称	回数	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)
流動性供給	346	-	4,000	2021/11/24		22,154.0	4,000.0		▲0.0070%	100.0000%		▲0.0070%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2021/11/24	2021/12/8		2,601	2,601				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/22	2021/11/24	▲ 0.350	38	38		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/22	2021/11/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/11/26	2021/12/2	0.330	0	0				

## ●2021年11月24日の予定

*米国7-9月期のGDP改定値	*国庫短期証券(1040回)入札
*米国10月の新築一戸建て販売件数	(6ヶ月、34,500億円、11/25発行)
*米国10月の耐久財新規受注	
*米国10月の個人所得・消費支出	

◆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