

Central Daily Market Report

2021年11月25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25日		2021年11月26日		2021年11月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 3,400		▲ 5,300		7,000	
資金過不足	▲ 4,900		▲ 6,100		6,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	14,900					
CP等買入		▲ 400		▲ 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		▲ 100		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別			69,200	▲ 55,300		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
*ドル資金供給用担保提供額						
当増減	9,700		7,600		6,000	
当座預金残高	5,354,400		5,362,000		5,368,000	
準備預金残高	4,707,200					
積み終了先	4,706,800		11月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,706,800		積数		2,500	
非準備預金先	647,200		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	99.93%	日数	33.33%		

●2021年11月25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~▲0.010%の出会いが見られた。一巡後は出し手の調整による散発的な出会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、▲0.10~▲0.095%程度での出会い。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＞

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態からまとまった発行が実施された。発行レートは引き続き横ばい圏での推移となった。また、CP等買入オペアが5,000億円でおファーされ、按分落札レート▲0.014%、平均落札レート▲0.011%といずれのレートも前回から上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2021/11/25	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	▲ 0.042				-	▲ 0.099	0.080	0.000	29,499.28	196.62	115.41-42	115.38-39
T/N			▲ 0.048				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.034				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.030	▲ 0.008	▲ 0.016				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.030	▲ 0.007	▲ 0.019				-	▲ 0.109						
3M			0.050				▲ 0.155	▲ 0.117						
6M							▲ 0.144	▲ 0.124						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.131						
									日付	11/17	11/18	11/19	11/22	11/24
									日銀当預残	5,356,900	5,367,100	5,359,400	5,349,700	5,344,700
									準備預金残	4,715,300	4,724,300	4,709,300	4,706,800	4,697,500
									マネタリーベース	6,578,000	6,589,300	6,582,200	6,573,300	6,568,600
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.038%	▲0.037%	▲0.038%	▲0.041%
									コール市場残高	194,937	189,807	194,101	190,578	186,774
									うち無担	176,711	172,653	176,890	173,297	169,169
									うちO/N	95,743	91,415	97,617	92,974	89,416
									うち有担	18,226	17,154	17,211	17,281	17,605

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
40年利付国債	14	0.700%	6,000	2021/11/26	2061/3/20	14,190.0	5,994.0	99,1500	0.7250%	91.4874%				
交付税特会	-	-	11,000	2021/12/3	2022/6/2	480,381.0	10,990.23		0.0000%	2.2879%		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	申込総額(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
CP等買入	5,000	2021/11/30			7,822	4,999	▲0.014		▲0.011	29.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/25	2021/11/26	▲0.350	133	133		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/25	2021/11/26	▲0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/11/26時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/11/26	2022/5/27	0	69,228	804,993

●2021年11月26日の予定

*11月の都区部消費者物価指数(CPI)

市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.4%

*国庫短期証券(1041回)入札

(3ヶ月、43,000億円、11/29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