

Central Daily Market Report

2021年11月26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26日 | | 2021年11月29日 | | 2021年11月30日 | |
|-------------------------------|-------------|----------|------------------|-------|-------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 800 | | ▲ 700 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | ▲ 7,800 | | 4,800 | | 5,900 | |
| 資金過不足 | ▲ 8,600 | | 4,100 | | 4,900 | |
| 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 | | | | | | |
| CP等買入 | | ▲ 200 | | ▲ 400 | 5,000 | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | ▲ 100 | | | | |
| 新型コロナウイルス対応金融支援特別 | 69,200 | ▲ 55,300 | | | | |
| E T F 買入 | | | | | | |
| 国債補充供給 | ▲ 100 | 100 | | 100 | | |
| <small>※ドル資金供給用担保提供供給</small> | | | | | | |
| 当預増減 | 5,000 | | 3,800 | | 9,900 | |
| 当座預金残高 | 5,359,400 | | 5,363,200 | | 5,373,100 | |
| 準備預金残高 | 4,710,500 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,710,200 | | 11月29日以降の残り所要積立額 | | | |
| 超過準備 | 4,710,100 | | 積数 | | 1,400 | |
| 非準備預金先 | 648,900 | | 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 | | 99.96% | | 日数 | |
| | | | | | 43.33% | |

●2021年11月26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~▲0.010%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今週の取引を終えた。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>

26日はTB3M物(1041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物と6M物のカレント銘柄にも出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は月末発行にあたり幅広い業態から発行が実施された。発行レートに変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

| 2021/11/26 | 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 | ▲ 0.085 | 0.001 | ▲ 0.043 | | | | - | ▲ 0.098 | 0.070 | ▲ 0.010 | 28,751.62 | ▲ 747.66 | 115.06-08 | 114.16-17 |
| T/N | | | ▲ 0.055 | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | | | | | | | - | ▲ 0.103 | | | | | | |
| 2W | | | ▲ 0.008 | | | | - | ▲ 0.104 | | | | | | |
| 3W | | | ▲ 0.002 | | | | - | ▲ 0.105 | | | | | | |
| 1M | ▲ 0.010 | ▲ 0.005 | ▲ 0.007 | | | | - | ▲ 0.108 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | - | ▲ 0.165 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | - | ▲ 0.147 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | - | ▲ 0.140 | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | |

●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 | 1041 | - | 43,000 | 2021/11/29 | 2022/3/7 | 144,514.0 | 34,980.6 | 100.0395 | ▲0.1470% | 89.2176% | 100.0408 | ▲0.1518% | 8,019.0 |

●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 |
|---------------------------|----------------|------------|------------|---------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2021/11/26 | 2021/11/29 | ▲ 0.350 | 53 | 53 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2021/11/26 | 2021/11/29 | ▲ 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・百万ドル) | 貸付先数 |
|--------|-----------------|-----------|------|-----------------|-------|
| 成長基盤強化 | 本則第46回 | 2021/12/1 | | 0 | 2,464 |
| 成長基盤強化 | 米ドル特則第38期 | 2021/12/3 | | | 853 |
| 成長基盤強化 | 米ドル特則第34期(借り換え) | 2021/12/3 | | | 2,944 |
| 成長基盤強化 | 米ドル特則第30期(借り換え) | 2021/12/3 | | | 255 |
| 成長基盤強化 | 米ドル特則第26期(借り換え) | 2021/12/3 | | | 461 |

●2021年11月29日の予定

*パリ・ユーロプラス主催
「Tokyo International Financial Forum 2021」において黒田総裁講演
*10月の商業動態統計速報

◆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