Central Daily Market Report

2021年12月2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12月2日 需給速報		2021年12月3日 需給予想		2021年12月6日 当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 68,100		▲ 25,500		6,000	
資金過不足	▲ 69,700		▲ 26,600		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 700		
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		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	700		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 69,200		▲ 27,300		5,000	

当座預金残高	5,265,300	5,238,000	5,243,000
準備預金残高	4,626,500		
積み終了先	4,626,500		
超過準備	4,626,200		
非準備預金先	638,800		

12月3日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	0

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	99.99%	日数 56.67%

●2021年12月2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▲0.085～▲0.02%での調達で始まった。前日比でレート水準に大きな変化はなく、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.100～▲0.085%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>

2日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/12/2	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.050				－	▲ 0.090
T/N	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.013				－	▲ 0.092
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.026				－	▲ 0.094
2W	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.028				－	▲ 0.098
3W			0.000				－	▲ 0.102
1M			0.150				－	▲ 0.114
3M							▲ 0.156	▲ 0.118
6M							▲ 0.144	▲ 0.127
1Y							▲ 0.139	▲ 0.136

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.055	▲ 0.005	27,753.37	▲ 182.25	112.87-89	113.26-28

日付	11/25	11/26	11/29	11/30	12/1
日銀当預残	5,354,400	5,359,400	5,359,100	5,377,400	5,334,500
準備預金残	4,707,300	4,710,700	4,712,900	4,733,400	4,691,400
マネタリーベース	6,579,900	6,585,700	6,586,100	6,604,500	6,562,800
無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.043%	▲0.047%	▲0.048%	▲0.050%
コール市場残高	184,865	193,111	187,018	183,612	176,749
うち無担	167,592	175,741	167,841	165,990	158,139
うちO/N	86,489	94,163	87,183	87,502	81,751
うち有担	17,273	17,370	19,177	17,622	18,610

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	364	0.10%	26,000	2021/12/3	2031/9/20	67,123.0	21,215.00	100.3600	**0.0630%**	**63.0466%**	100.3800	**0.0600%**	4,771.0	4.54

●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）		2021/12/2	2021/12/3	▲ 0.350	97	97		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/12/2	2021/12/3	▲ 0.350	0	0				

●2021年12月3日の予定

*12月の日銀当座預金増減要因見込み
*米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国11月の雇用統計
*米国11月のISM非製造業景況指数
*国庫短期証券（1042回）入札
（3ヶ月、43,000億円、12/6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。
◆本資料は何ら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論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