

# Central Daily Market Report

2021年12月3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12月3日		2021年12月6日		2021年12月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 300		▲ 1,000	
財政	▲ 26,300		11,400		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 27,400		11,100		▲ 4,000	
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			10,700			
CP等買入		▲ 700		▲ 100		
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		▲ 300		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 28,200		21,500		▲ 4,000	
当座預金残高	5,237,100		5,258,600		5,254,600	
準備預金残高	4,625,200					
積み終了先	4,625,200				12月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,625,200				積数	100
非準備預金先	611,900				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	100.00%	日数	66.67%		

## ●2021年12月3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～▲0.010%での調達で始まった。前日比でレート水準は上昇し、一巡後も朝方と同水準の出合いが数件見られ、今週の取引を終えた。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、▲0.090～▲0.080%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＞

3日はTB3M物(1042回)の入札が実施され、やや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、底堅く推移した。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、一部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

2021/12/3	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				-	▲ 0.087	0.050	▲ 0.005	28,029.57	276.20	113.02-03	113.37-38
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.053	▲ 0.003	▲ 0.039				-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.145	▲ 0.118						
6M							▲ 0.144	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.136						
									日付	11/26	11/29	11/30	12/1	12/2
									日銀当預残	5,359,400	5,359,100	5,377,400	5,334,500	5,265,300
									準備預金残	4,710,700	4,712,900	4,733,400	4,691,400	4,626,600
									マネタリーベース	6,585,700	6,586,100	6,604,500	6,562,800	6,495,200
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.047%	▲0.048%	▲0.050%	▲0.050%
									コール市場残高	193,111	187,018	183,612	176,749	176,657
									うち無担	175,741	167,841	165,990	158,139	158,192
									うちO/N	94,163	87,183	87,502	81,751	80,524
									うち有担	17,370	19,177	17,622	18,610	18,465

## ●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	1042	-	43,000	2021/12/6	2022/3/14	132,246.0	34,980.6	100.0390	▲0.1451%	27.7227%	100.0417	▲0.1552%	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/12/6			15,135	4,504	0.003		0.003	89.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/12/6			12,438	4,506	▲0.004		▲0.003	26.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2021/12/6			4,942	1,512	▲0.003		▲0.002	54.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/3	2021/12/6	▲0.350	82	82		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/3	2021/12/6	▲0.350	0	0				

## ●2021年12月6日の予定

\*特にありません

◆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