

# Central Daily Market Report

2021年12月6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12月6日		2021年12月7日		2021年12月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	13,000		2,800		▲ 8,000	
資金過不足	12,800		1,700		▲ 9,000	
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						▲ 2,600
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		▲ 100		▲ 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		▲ 300				
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 500	100		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	22,700		2,100		▲ 11,600	
当座預金残高	5,259,800		5,261,900		5,250,300	
準備預金残高	4,661,500					
積み終了先	4,661,400		12月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,661,400		積数		100	
非準備預金先	598,300		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	70.00%		

## ●2021年12月6日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.08～▲0.015%の調達で始まった。週末対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継続して本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが散見される程度であった。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.085～▲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＞

6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発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2021/12/6	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.084	0.035	▲ 0.015	27,927.37	▲ 102.20	113.04-05	113.14-15
T/N	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.087						
2W							-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.145	▲ 0.117						
6M							▲ 0.144	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.135						
									日付	11/29	11/30	12/1	12/2	12/3
									日銀当預残	5,359,100	5,377,400	5,334,500	5,265,300	5,237,100
									準備預金残	4,712,900	4,733,400	4,691,400	4,626,600	4,625,700
									マネタリーベース	6,586,100	6,604,500	6,562,800	6,495,200	6,468,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.048%	▲ 0.050%	▲ 0.050%	▲ 0.043%
									コール市場残高	187,018	183,612	176,749	176,657	171,541
									うち無担	167,841	165,990	158,139	158,192	152,830
									うちO/N	87,183	87,502	81,751	80,524	72,872
									うち有担	19,177	17,622	18,610	18,465	18,711

## ●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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)		2021/12/6	2021/12/7	▲ 0.350	463	463		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/6	2021/12/7	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年12月7日の予定

*10月の全世帯家計調査 市場予想:消費支出、前年比▲0.6%	*米国10月の貿易収支	*30年利付国債入札 (9,000億円、12/8発行)
*10月の毎月勤労統計調査速報	*米国10月の消費者信用残高	
*10月の景気動向指数速報	*ユーロ圏7-9月期のGDP確報値	
*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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