

# Central Daily Market Report

2021年12月7日(火)  
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7日 需給速報	2021年12月8日 需給予想	2021年12月9日 当社予想
銀行券	▲ 1,100	▲ 900	▲ 2,000
財政	2,500	▲ 8,600	▲ 2,000
資金過不足	1,400	▲ 9,500	▲ 4,000
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,500	▲ 2,600
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		1,000	
国債買入			
CP等買入	▲ 100	▲ 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	
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F買入			
国債補完供給	▲ 500	500	500
※ドル資金供給用担保提供			
<b>当増減</b>	1,300	▲ 8,400	▲ 4,000
当座預金残高	5,261,100	5,252,700	5,248,700
準備預金残高	4,669,000		
積み終了先	4,669,000		12月8日以降の残り所要積立額
超過準備	4,669,000		積数
非準備預金先	592,100		1日平均
			0
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			3,637,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			73.33%

## ●2021年12月7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▲0.065～▲0.01%の調達で始まった。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＞

7日は短国買入オベが前回と同額(1,000億円)オファーされ、弱めの結果となった。マーケットでは特段の出合いは見られなかった。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/12/7	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.084	0.050	0.015	28,455.60	528.23	113.46-48	113.63-65
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.012	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.144	▲ 0.116						
6M							▲ 0.144	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.134						
									日付	11/30	12/1	12/2	12/3	12/6
									日銀当預残	5,377,400	5,334,500	5,265,300	5,237,100	5,259,800
									準備預金残	4,733,400	4,691,400	4,626,600	4,625,700	4,658,400
									マネタリーベース	6,604,500	6,562,800	6,495,200	6,468,100	6,490,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.050%	▲ 0.050%	▲ 0.043%	▲ 0.035%
									コール市場残高	183,612	176,749	176,657	171,541	158,449
									うち無担	165,990	158,139	158,192	152,830	139,967
									うちO/N	87,502	81,751	80,524	72,872	59,334
									うち有担	17,622	18,610	18,465	18,711	18,482

## ●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)
30年利付国債	72	0.700%	9,000	2021/12/8	2051/9/20	23,446.0	7,294.00	100.55	0.6770%	14.8255%	100.6500	0.6730%	1,697.0

## ●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)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均貸付レート・利回較差・価格較差	貸付比率
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/12/8	2021/12/22		2,501	2,501				
国庫短期証買入	1,000	2021/12/8			7,805	1,001	0.015		0.015	90.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/7	2021/12/8	▲ 0.350	518	518		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/7	2021/12/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/12/9	2021/12/16	0.330	3	3				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/12/10			2,204	1,251	▲ 0.042		▲ 0.032	34.2

## ●2021年12月8日の予定

\*7-9月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率▲0.8%)  
\*10月の国際収支  
\*11月の景気ウォッチャー調査

\*交付税特別会計借入  
(11,000億円、12/17借入)

◆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