

# Central Daily Market Report

2021年12月9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9日		2021年12月10日		2021年12月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,400		▲ 1,000		▲ 2,000	
財政	▲ 1,900		▲ 26,000		6,000	
資金過不足	▲ 4,300		▲ 27,000		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	10,400					
CP等買入		▲ 400		▲ 600		
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	1,300			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 100	800		100		
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	6,300		▲ 26,200		4,000	
当座預金残高	5,259,100		5,232,900		5,236,900	
準備預金残高	4,679,000					
積み終了先	4,679,000				12月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,679,000				積数 100	
非準備預金先	580,100				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	80.00%		

## ●2021年12月9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▲0.055～▲0.008%の調達で始まった。前日対比でレートは上昇。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、▲0.080～▲0.070%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＞

9日はTDB6M物(1043回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、軟調に推移した。

### ＜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

2021/12/9	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.083	0.045	0.000	28,725.47	▲ 135.15	113.69-71	113.48-50
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.002	▲ 0.019				-	▲ 0.084						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.097						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.140	▲ 0.117						
6M							▲ 0.107	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.134						
									日付	12/2	12/3	12/6	12/7	12/8
									日銀当預残	5,265,300	5,237,100	5,259,800	5,261,100	5,252,800
									準備預金残	4,626,600	4,625,700	4,658,400	4,669,500	4,659,900
									マネタリーベース	6,495,200	6,468,100	6,490,900	6,493,400	6,485,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.050%	▲ 0.043%	▲ 0.035%	▲ 0.028%	▲ 0.022%
									コール市場残高	176,657	171,541	158,449	162,304	160,009
									うち無担	158,192	152,830	139,967	144,323	142,243
									うちO/N	80,524	72,872	59,334	62,170	61,615
									うち有担	18,465	18,711	18,482	17,981	17,766

## ●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	1043	-	34,500	2021/12/10	2022/6/10	97,023.0	28,068.7	100.0530	▲0.1062%	29.6576%	100.0550	▲0.1102%	6,431.0
5年利付国債	149	0.005%	25,000	2021/12/10	2026/9/20	73,710.0	20,327.00	100.4300	▲0.0840%	85.6453%	100.4400	▲0.0860%	4,664.0

## ●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)		2021/12/9	2021/12/10	▲ 0.350	120	120		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/9	2021/12/10	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年12月10日の予定

*10月の特定サービス産業動態統計速報	*米国11月の財政収支	*国庫短期証券(1044回)入札(3ヶ月、43,000億円、12/13発行)
*11月の企業物価指数	*米国11月の消費者物価指数	*エネルギー対策借入(6,500億円、12/20借入)
	*米国12月のシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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