Central Daily Market Report

2021年12月10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10日 需給速報		2021年12月13日 需給予想		2021年12月14日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	▲ 27,700		4,400		2,000	
資金過不足	▲ 28,700		3,300		0	
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		▲ 600		▲ 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	1,300					
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 28,200		3,400		0	

当座預金残高	5,230,900	5,234,300	5,234,300
準備預金残高	4,696,900		
積み終了先	4,696,900		
超過準備	4,696,900		
非準備預金先	534,000		

12月13日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 90.00%

●2021年12月10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▲0.025～▲0.003%の調達で始まった。三日積みということもあり、レートは前日対比で上昇した。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、▲0.060～▲0.045%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>

10日はTDB3M物（1044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、底堅く推移した。

<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

2021/12/10	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.008				－	▲ 0.060
T/N	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.005				－	▲ 0.054
S/N							－	－
1W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.006				－	▲ 0.069
2W							－	▲ 0.082
3W							－	▲ 0.098
1M	▲ 0.007	0.150	0.045				－	▲ 0.102
3M							▲ 0.120	▲ 0.111
6M							▲ 0.110	▲ 0.124
1Y							▲ 0.128	▲ 0.133

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）
0.050	0.005	28,437.77	▲ 287.70	113.43-45	113.58-59

日付	12/3	12/6	12/7	12/8	12/9
日銀当預残	5,237,100	5,259,800	5,261,100	5,252,800	5,259,100
準備預金残	4,625,700	4,658,400	4,669,500	4,659,900	4,679,000
マネタリーベース	6,468,100	6,490,900	6,493,400	6,485,900	6,494,600
無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.035%	▲0.028%	▲0.022%	▲0.015%
コール市場残高	171,541	158,449	162,304	160,009	165,954
うち無担	152,830	139,967	144,323	142,243	148,090
うちO/N	72,872	59,334	62,170	61,615	66,662
うち有担	18,711	18,482	17,981	17,766	17,864

●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)
国庫短期証券	1044	－	43,000	2021/12/13	2022/3/22	137,330.0	34,980.6	100.0290	▲0.1068%	41.7651%	100.0316	▲0.1164%	8,019.0
エネルギー対策	－	－	6,500	2021/12/20	2022/12/20	211,597.0	6,499.92		0.0000%	3.0719%		0.0000%	

●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）		2021/12/10	2021/12/13	▲ 0.350	267	267		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/12/10	2021/12/13	▲ 0.350	0	0				

●2021年12月13日の予定

*12月調査の日銀短観（概要及び要旨）
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数（DI）＋18

*10月の機械受注統計
市場予想：船舶・電力除く民需、前月比＋2.1%

◆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