

# Central Daily Market Report

2021年11月1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11月1日		2021年11月2日		2021年11月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 300			1,000	
財政	▲ 22,200	▲ 39,600			▲ 6,000	
資金過不足	▲ 22,100	▲ 39,900			▲ 5,000	
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						
CP等買入		▲ 900				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 22,900		▲ 39,700		▲ 5,000	
当座預金残高	5,393,300		5,353,600		5,348,600	
準備預金残高	4,746,000					
積み終了先	4,746,000			11月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,745,600			積数	200	
非準備預金先	647,300			1日平均	0	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,735,100	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	54.84%		

## ●2021年11月1日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.065~▲0.010%での調達で始まった。先週比でレート水準は若干低下し、一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物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、▲0.10~▲0.09%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>

1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

2021/11/1	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	0.010	▲ 0.029				-	▲ 0.095	0.090	▲ 0.005	29,647.08	754.39	114.23-25	114.42-43
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.003	0.000	▲ 0.002				-	▲ 0.099						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.101						
1M	▲ 0.015	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.118	▲ 0.113						
6M							▲ 0.112	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.113	▲ 0.131						
									日付	10/25	10/26	10/27	10/28	10/29
									日銀当預残	5,408,500	5,405,200	5,413,900	5,424,100	5,416,200
									準備預金残	4,758,100	4,757,000	4,767,000	4,770,900	4,777,600
									マネタリーベース	6,629,200	6,626,600	6,636,100	6,647,900	6,640,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.027%	▲ 0.026%	▲ 0.027%	▲ 0.027%	▲ 0.027%
									コール市場残高	192,472	189,337	186,509	188,424	183,069
									うち無担	174,774	172,049	169,503	171,341	166,287
									うちO/N	91,596	90,879	88,033	88,521	86,197
									うち有担	17,698	17,288	17,006	17,083	16,782

## ●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	364	0.10%	26,000	2021/11/2	2031/9/20	66,513.0	21,205.00	99.8800	0.1120%	60.6167%	99.9300	0.1070%	4,785.0	4.85

## ●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)		2021/11/1	2021/11/2	▲ 0.350	186	186		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/1	2021/11/2	▲ 0.350	8	8		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2021年11月2日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(9月21・22日分)	*米国FOMC(1日目)	*交付税特別会計借入(11,000億円、11/12借入)
*10月実績/11月見込み財政資金対民間収支		
*10月のマネタリーベース		

◆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