

Central Daily Market Report

2021年11月29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29日		2021年11月30日		2021年12月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 200		▲ 1,000	
財政	900		6,200		▲ 33,000	
資金過不足	200		6,000		▲ 34,000	
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			9,400			
CP等買入		▲ 400	5,000	▲ 4,000		
貸出支援基金(成)					2,500	▲ 6,200
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	100		200		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 300		16,600		▲ 37,700	
当座預金残高	5,359,100		5,375,700		5,338,000	
準備預金残高	4,712,900					
積み終了先	4,712,600				11月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,712,600				積数	1,100
非準備預金先	646,200				1日平均	100
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	99.97%	日数	46.67%		

●2021年11月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.085~▲0.015%での調達で始まった。前営業日比でレート水準は低下し、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、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~▲0.090%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>

29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、複数の業態で大型発行が実施された。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

2021/11/29	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.098	0.070	0.000	28,283.92	▲ 467.70	113.71-73	113.56-58
T/N			▲ 0.055				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.120	0.000				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.050	0.050	▲ 0.021				-	▲ 0.103						
3W			▲ 0.035				-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.160	▲ 0.119						
6M							▲ 0.147	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.134						
									日付	11/19	11/22	11/24	11/25	11/26
									日銀当預残	5,359,400	5,349,700	5,344,700	5,354,400	5,359,400
									準備預金残	4,709,300	4,706,800	4,697,500	4,707,300	4,710,700
									マネタリーベース	6,582,200	6,573,300	6,568,600	6,579,900	6,585,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.037%	▲ 0.038%	▲ 0.041%	▲ 0.042%	▲ 0.043%
									コール市場残高	194,101	190,578	186,774	184,865	193,111
									うち無担	176,890	173,297	169,169	167,592	175,741
									うちO/N	97,617	92,974	89,416	86,489	94,163
									うち有担	17,211	17,281	17,605	17,273	17,370

●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	案分率	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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/11/30			9,714	4,502	0.000		0.000	90.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/11/30			11,917	4,260	0.002		0.002	83.6
国債買入(物価連動債)	600	2021/11/30			1,524	601	▲ 0.010		▲ 0.153	13.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/29	2021/11/30	▲ 0.350	148	148		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/29	2021/11/30	▲ 0.350	0	0				

●2021年11月30日の予定

*10月の完全失業率(市場予想:2.8%)	*米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(30,000億円、12/1発行)
*10月の有効求人倍率(市場予想:1.17倍)	*米国11月のCB消費者信頼感指数	
*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*米国11月のシカゴPM景況感指数	
市場予想:前月比+1.8%	*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値	
*10月の住宅着工統計		

◆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