

Central Daily Market Report

2021年11月30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11月30日		2021年12月1日		2021年12月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	8,100		▲ 41,600		▲ 78,000	
資金過不足	8,000		▲ 42,700		▲ 79,000	
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			1,000			
国債買入	9,400					
CP等買入	5,000	▲ 4,000		▲ 100		
貸出支援基金(成)			2,500	▲ 4,300		
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	▲ 300	200		300		
米ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	18,300		▲ 43,300		▲ 79,000	
当座預金残高	5,377,400		5,334,100		5,255,100	
準備預金残高	4,733,400					
積み終了先	4,733,100		12月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,733,100		積数		800	
非準備預金先	644,000		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	99.98%	日数	50.00%		

●2021年11月30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~▲0.02%での調達で始まった。月末要因によりビッドの件数が少なく、昨日よりも軟調な展開となった。一巡後は朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、今月の取引を終えた。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、▲0.095~▲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>

30日は短国買入オベが前回と同額(1,000億円)オファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは1Y物と6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態から発行が実施された。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

2021/11/30	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.094	0.055	▲ 0.015	27,821.76	▲ 462.16	113.80-81	113.18-19
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.100						
3W			▲ 0.003				-	▲ 0.103						
1M			▲ 0.005				-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.160	▲ 0.119						
6M							▲ 0.145	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.135						
									日付	11/22	11/24	11/25	11/26	11/29
									日銀当預残	5,349,700	5,344,700	5,354,400	5,359,400	5,359,100
									準備預金残	4,706,800	4,697,500	4,707,300	4,710,700	4,712,900
									マネタリーベース	6,573,300	6,568,600	6,579,900	6,585,700	6,586,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.041%	▲ 0.042%	▲ 0.043%	▲ 0.047%
									コール市場残高	190,578	186,774	184,865	193,111	187,018
									うち無担	173,297	169,169	167,592	175,741	167,841
									うちO/N	92,974	89,416	86,489	94,163	87,183
									うち有担	17,281	17,605	17,273	17,370	19,177

●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)
2年利付国債	431	0.005%	30,000	2021/12/1	2023/12/1	99,425.0	24,539.0	100.2500	▲0.1190%	50.7844%	100.2530	▲0.1210%	5,451.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2021/12/1			7,195	1,001	0.005		0.005	51.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/11/30	2021/12/1	▲ 0.350	297	297		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/11/30	2021/12/1	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/12/2	2021/12/9	0.330	0	0				

●2021年12月1日の予定

*安達日銀審議委員、大分県金融経済懇談会において講演	*米国11月のISM製造業景況指数	*交付税特別会計借入(11,000億円、12/10借入)
*7-9月期の法人企業統計調査季報	*米国10月の建設支出	
	*米国ページブック	

◆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