

Central Daily Market Report

2021年10月1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10月1日		2021年10月4日		2021年10月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		500		0	
財政	▲ 19,900		▲ 36,800		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 19,900		▲ 36,300		▲ 2,000	
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						
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	1,300		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 18,800		▲ 36,100		▲ 2,000	
当座預金残高	5,397,900		5,361,800		5,359,800	
準備預金残高	4,793,500					
積み終了先	4,793,500		10月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,793,500		積数		100	
非準備預金先	604,400		1日平均		0	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,615,500	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	60.00%		

●2021年10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、邦銀業態を中心に▲0.060～▲0.001%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが継続し、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あった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.075～▲0.07%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＞

本日はTB3M物(1027回)の入札が実施され、年末越えの需要もあり、やや強めの結果となった。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

2021/10/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	売買参考値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.079	0.050	▲ 0.015	28,771.07	▲ 681.59	111.46-47	111.26-27
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.086						
3W			▲ 0.003				-	▲ 0.092						
1M	▲ 0.018	0.200	0.002				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.134	▲ 0.109						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.130						
									日付	9/24	9/27	9/28	9/29	9/30
									日銀当預残	5,419,200	5,425,100	5,429,200	5,418,000	5,416,700
									準備預金残	4,774,700	4,778,100	4,791,400	4,800,300	4,806,100
									マネタリーベース	6,637,700	6,643,100	6,646,800	6,636,000	6,634,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.024%	▲ 0.025%	▲ 0.025%	▲ 0.049%
									コール市場残高	182,934	183,493	181,221	168,105	119,971
									うち無担	165,371	166,222	163,865	149,834	103,650
									うちO/N	81,428	81,079	75,962	62,111	53,702
									うち有担	17,563	17,271	17,356	18,271	16,321

●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	1027	-	50,000	2021/10/4	2022/1/11	155,035.0	40,613.5	100.0345	▲0.1271%	94.6548%	100.0361	▲0.1330%	9,386.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/10/1	2021/10/4	▲ 0.350	177	177		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/1	2021/10/4	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月4日の予定

*9月実績/10月見込み財政資金対民間収支
*9月のマネタリーベース

*米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫

◆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