

Central Daily Market Report

2021年10月4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10月4日		2021年10月5日		2021年10月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		800		0	
財政	▲ 42,500		1,100		▲ 24,000	
資金過不足	▲ 42,100		1,900		▲ 24,000	
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			10,700			
CP等買入				▲ 100		
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	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 42,000		12,600		▲ 24,000	
当座預金残高	5,355,900		5,368,500		5,344,500	
準備預金残高	4,753,700					
積み終了先	4,753,700		10月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,753,700		積数		100	
非準備預金先	602,200		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	63.33%		

●2021年10月4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▲0.045~▲0.001%での調達で始まった。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、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.075%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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部で大型発行も見られたが案件は少なかった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/10/4	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.082	0.045	▲ 0.005	28,444.89	▲ 326.18	110.95-96	111.16-18
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.003	0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.003	▲ 0.002	▲ 0.002				-	▲ 0.085						
3W			▲ 0.003				-	▲ 0.092						
1M	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.134	▲ 0.110						
6M							▲ 0.122	▲ 0.121						
1Y			0.145				▲ 0.119	▲ 0.131						
									日付	9/27	9/28	9/29	9/30	10/1
									日銀当預残	5,425,100	5,429,200	5,418,000	5,416,700	5,397,900
									準備預金残	4,778,100	4,791,400	4,800,300	4,806,100	4,792,400
									マネタリーベース	6,643,100	6,646,800	6,636,000	6,634,900	6,616,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.024%	▲ 0.025%	▲ 0.025%	▲ 0.049%	▲ 0.018%
									コール市場残高	183,493	181,221	168,105	119,971	159,983
									うち無担	166,222	163,865	149,834	103,650	142,713
									うちO/N	81,079	75,962	62,111	53,702	69,555
									うち有担	17,271	17,356	18,271	16,321	17,270

●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1年超3年以下)	4,500	2021/10/5			11,595	4,507	▲0.003		▲0.002	45.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/10/5			11,857	4,506	▲0.004		▲0.004	84.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2021/10/5			4,578	1,512	▲0.004		▲0.004	53.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2021/10/4	2021/10/5	▲ 0.350	45	45		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2021/10/4	2021/10/5	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月5日の予定

*黒田総裁、TCFDサミット2021において講演	*米国8月の貿易収支	*10年利付国債入札(26,000億円、10/6発行)
*9月の都区部消費者物価指数(CPI)	*米国9月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入(11,000億円、10/15借入)
市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.2%		
*10月の日銀当座預金増減要因見込み		

◆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