

Central Daily Market Report

2021年10月6日(水)
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6日		2021年10月7日		2021年10月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 300		▲ 1,000	
財政	▲ 26,300		3,200		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 26,100		2,900		▲ 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	1,000					
国債買入						
CP等買入				▲ 200		
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			200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 25,300		2,900		▲ 5,000	
当座預金残高	5,343,100		5,346,000		5,341,000	
準備預金残高	4,740,100					
積み終了先	4,740,000				10月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,740,000				積数	100
非準備預金先	603,000				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	70.00%		

●2021年10月6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▲0.025~▲0.001%での調達で始まった。前日比でレート水準は上昇し、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、▲0.090~▲0.080%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、特段の出合いは見られなかった。

<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

2021/10/6	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.084	0.080	0.020	27,528.87	▲ 293.25	111.48-50	111.67-68
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.002				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.001	0.000	▲ 0.001				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.134	▲ 0.109						
6M							▲ 0.122	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.131						
									日付	9/29	9/30	10/1	10/4	10/5
									日銀当預残	5,418,000	5,416,700	5,397,900	5,355,900	5,368,400
									準備預金残	4,800,300	4,806,100	4,792,400	4,753,200	4,740,400
									マネタリーベース	6,636,000	6,634,900	6,616,200	6,573,700	6,585,500
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.049%	▲0.018%	▲0.017%	▲0.015%
									コール市場残高	168,105	119,971	159,983	154,662	156,193
									うち無担	149,834	103,650	142,713	136,189	137,707
									うちO/N	62,111	53,702	69,555	58,876	58,744
									うち有担	18,271	16,321	17,270	18,473	18,486

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/10/6	2021/10/7	▲ 0.350	192	192		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/6	2021/10/7	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/10/11			2,279	1,250	▲ 0.052		▲ 0.045	24.6

●2021年10月7日の予定

*8月の景気動向指数速報	*米国8月の米消費者信用残高	*国庫短期証券(1028回)入札(6ヶ月、34,500億円、10/11発行)
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引		*流動性供給入札(5,000億円、10/8発行)

◆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