Central Daily Market Report

2021年10月7日（木）
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7日 需給速報		2021年10月8日 需給予想		2021年10月11日 当社予想	
銀行券	▲ 300		300		1,000	
財政	4,200		5,700		▲ 17,000	
資金過不足	3,900		6,000		▲ 16,000	
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		▲ 200		▲ 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					1,300	
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 800	200		800		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	3,100		6,600		▲ 14,700	

当座預金残高	5,346,200	5,352,800	5,338,100
準備預金残高	4,737,600		
積み終了先	4,737,500		
超過準備	4,737,500		
非準備預金先	608,600		

10月8日以降の残り所要積立額	
積数	0
1日平均	0

積み期間（9/16～10/15）の所要準備額			3,615,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 73.33%

●2021年10月7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▲0.015～▲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>
本日はTB6M物(1028回)の入札が実施され、無難な結果となった。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、複数の業態から発行が見られた。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

2021/10/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.009				－	▲ 0.083
T/N							－	▲ 0.082
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.012				－	▲ 0.084
2W	▲ 0.013	▲ 0.008	▲ 0.010				－	▲ 0.086
3W							－	▲ 0.092
1M	▲ 0.010	0.150	0.007				－	▲ 0.098
3M							▲ 0.134	▲ 0.109
6M							▲ 0.117	▲ 0.121
1Y							▲ 0.119	▲ 0.131

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.070	▲ 0.010	27,678.21	149.34	111.40-41	111.29-30

日付	9/30	10/1	10/4	10/5	10/6
日銀当預残	5,416,700	5,397,900	5,355,900	5,368,400	5,343,100
準備預金残	4,806,100	4,792,400	4,753,200	4,740,400	4,740,100
マネタリーベース	6,634,900	6,616,200	6,573,700	6,585,500	6,559,900
無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.018%	▲0.017%	▲0.015%	▲0.012%
コール市場残高	119,971	159,983	154,662	156,193	157,144
うち無担	103,650	142,713	136,189	137,707	139,087
うちO/N	53,702	69,555	58,876	58,744	60,274
うち有担	16,321	17,270	18,473	18,486	18,057

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1028	－	34,500	2021/10/11	2022/4/11	120,926.0	28,058.3	100.0550	▲0.1102%	81.3913%	100.0570	▲0.1142%	6,441.0
流動性供給	343	－	5,000	2021/10/8		19,662.0	4,980.00		▲0.0070%	96.3700%		▲0.0070%	

●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）		2021/10/7	2021/10/8	▲ 0.350	731	731		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/10/7	2021/10/8	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月8日の予定

*8月の全世帯家計調査
　市場予想：消費支出、前年比▲1.5%
*8月の毎月勤労統計調査速報
*8月の国際収支
*8月の特定サービス産業動態統計速報
*9月の景気ウォッチャー調査
*米国8月の卸売売上高
*米国9月の雇用統計
*国庫短期証券(1029回)入札
（3ヶ月、50,000億円、10/11発行）
*エネルギー対策借入
（6,500億円、10/20借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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