

Central Daily Market Report

2021年10月8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8日		2021年10月11日		2021年10月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		600		0	
財政	7,200		▲ 25,700		▲ 1,000	
資金過不足	7,500		▲ 25,100		▲ 1,000	
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			14,800			
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	800		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	7,700		▲ 8,800		▲ 1,000	
当座預金残高	5,353,900		5,345,100		5,344,100	
準備預金残高	4,767,900					
積み終了先	4,767,900				10月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,767,900				積数	0
非準備預金先	586,000				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	83.33%		

●2021年10月8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▲0.01～▲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、今週の取引を終えた。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、▲0.085～▲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TB3M物(1029回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは小甘く推移した。

＜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

2021/10/8	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.084	0.080	0.010	28,048.94	370.73	111.66-67	111.95-96
T/N							-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.083						
2W							-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.093						
1M	▲ 0.002	0.150	0.049				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.108	▲ 0.109						
6M							▲ 0.117	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.131						
									日付	10/1	10/4	10/5	10/6	10/7
									日銀当預残	5,397,900	5,355,900	5,368,400	5,343,100	5,346,200
									準備預金残	4,792,400	4,753,200	4,740,400	4,740,100	4,737,600
									マネタリーベース	6,616,200	6,573,700	6,585,500	6,559,900	6,563,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.017%	▲ 0.015%	▲ 0.012%	▲ 0.009%
									コール市場残高	159,983	154,662	156,193	157,144	163,387
									うち無担	142,713	136,189	137,707	139,087	145,385
									うちO/N	69,555	58,876	58,744	60,274	66,022
									うち有担	17,270	18,473	18,486	18,057	18,002

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1029	-	50,000	2021/10/11	2022/1/17	119,147.0	40,613.8	100.0295	▲ 0.1098%	46.9024%	100.0322	▲ 0.1198%	9,386.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2021/10/20	2022/10/20	214,093.0	6,499.86		0.0000%	3.0361%		0.0000%	

●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)	着札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均着札レート・利回差・価格差	貸付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/10/11			5,538	1,503	0.004		0.007	35.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/10/11			15,211	4,509	0.003		0.003	97.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/10/11			12,344	4,504	0.005		0.006	64.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/10/11			9,069	4,256	0.011		0.011	77.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/10/8	2021/10/11	▲ 0.350	414	414		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/8	2021/10/11	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月11日の予定

*米国祝日(Columbus Day)

◆本資料は信頼できるとさ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