

# Central Daily Market Report

2021年10月11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11日		2021年10月12日		2021年10月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		200		0	
財政	▲ 28,200		6,600		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 27,700		6,800		▲ 8,000	
<b>金融調節</b>	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						▲ 4,000
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	14,800					
CP等買入		▲ 200		▲ 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	1,300					
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	400		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 11,500		6,800		▲ 12,000	
当座預金残高	5,342,400		5,349,200		5,337,200	
準備預金残高	4,756,200					
積み終了先	4,756,200				10月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,756,200				積数	
非準備預金先	586,200				1日平均	
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	86.67%		

## ●2021年10月11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▲0.04~▲0.001%での調達で始まった。先週比でレート水準は低下し、一巡後は▲0.05%程度の出合いが数件見られ、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、▲0.085~▲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市場は、複数の入札が行われた。発行レートは、前回実施された水準と概ね同水準であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/10/11	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.082	0.090	0.010	28,498.20	449.26	112.26-27	112.78-80
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.110	▲ 0.108						
6M							▲ 0.118	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.130						
									日付	10/4	10/5	10/6	10/7	10/8
									日銀当預残	5,355,900	5,368,400	5,343,100	5,346,200	5,353,900
									準備預金残	4,753,200	4,740,400	4,740,100	4,737,600	4,767,900
									マネタリーベース	6,573,700	6,585,500	6,559,900	6,563,300	6,570,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.015%	▲ 0.012%	▲ 0.009%	▲ 0.008%
									コール市場残高	154,662	156,193	157,144	163,387	157,036
									うち無担	136,189	137,707	139,087	145,385	139,036
									うちO/N	58,876	58,744	60,274	66,022	62,723
									うち有担	18,473	18,486	18,057	18,002	18,000

## ●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)		2021/10/11	2021/10/12	▲ 0.350	63	63		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/11	2021/10/12	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年10月12日の予定

*9月の企業物価指数	*30年利付国債入札(9,000億円、10/13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