

Central Daily Market Report

2021年10月13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13日		2021年10月14日		2021年10月15日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想
銀行券	100	▲ 900	▲ 900	▲ 900	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	▲ 4,700	4,100	4,100	4,100	49,000	49,000
資金過不足	▲ 4,600	3,200	3,200	3,200	48,000	48,000
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	2,400	▲ 4,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			9,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
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						
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 5,300	12,200	12,200	12,200	48,000	48,000
当座預金残高	5,347,600	5,359,800	5,359,800	5,359,800	5,407,800	5,407,800
準備預金残高	4,727,300					
積み終了先	4,727,300					
超過準備	4,727,300					
非準備預金先	620,300					
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,615,800	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	93.33%		

●2021年10月13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▲0.07~▲0.001%と幅広いレンジの調達で始まった。レート水準は昨日と横ばい圏で推移し、一巡後は▲0.065~▲0.04%程度の出合いが見られた。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.125~▲0.110%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、1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、大型を含めて複数の入札が実施された。発行レートは、銘柄毎の水準がまちまちであるものの、マイナス圏であることに変わりなかった。CP等買入オベの結果は、応札9,242億円、落札4,990億円、平均レート▲0.010%、按分レート▲0.015%となった。レートは前回比でいずれも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2021/10/13	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	
	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)	為替(17時)
単位:%							売買参考統計値	平均値	0.085	▲ 0.005	28,140.28	▲ 90.33	113.53-54	113.57-58
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.106						
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.124						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.002				-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.045	▲ 0.003	▲ 0.037				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.108						
1M			▲ 0.005				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.112	▲ 0.112						
6M							▲ 0.118	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.130						
日付		10/6	10/7	10/8	10/11	10/12								
日銀当預残	5,343,100	5,346,200	5,353,900	5,342,400	5,352,900									
準備預金残	4,740,100	4,737,600	4,767,900	4,756,200	4,743,500									
マネタリーベース	6,559,900	6,563,300	6,570,800	6,558,700	6,569,000									
無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.009%	▲ 0.008%	▲ 0.021%	▲ 0.032%									
コール市場残高	157,144	163,387	157,036	157,640	155,619									
うち無担	139,087	145,385	139,036	139,305	138,007									
うちO/N	60,274	66,022	62,723	62,532	61,214									
うち有担	18,057	18,002	18,000	18,335	17,612									

●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)
交付税特会	-	-	11,000	2021/10/22	2022/4/22	455,123.0	11,000.27		0.0000%	2.4170%		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	買付利率	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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/10/14			12,464	4,505	▲ 0.004		▲ 0.002	3.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/10/14			9,304	4,262	▲ 0.006		▲ 0.005	43.3
国債買入(変動利付債)	300	2021/10/14			730	300		▲ 1.200	▲ 1.208	
CP等買入	5,000	2021/10/18			9,242	4,990	▲ 0.015		▲ 0.010	63.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/10/13	2021/10/14	▲ 0.350	16	16		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/13	2021/10/14	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月14日の予定

*野口日銀審議委員、鳥取県金融経済懇談会において講演	*米国9月の生産者物価指数	*5年利付国債入札(25,000億円、10/15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