

Central Daily Market Report

2021年10月14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14日		2021年10月15日		2021年10月18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	▲ 900	200				0
財政	2,700	56,800				1,000
資金過不足	1,800	57,000				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	9,300					
CP等買入		▲ 300		▲ 400		5,000
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	10,700		56,500		6,000	
当座預金残高	5,358,300		5,414,800		5,420,800	
準備預金残高	4,732,100					
積み終了先	4,732,100					
超過準備	4,732,100					
非準備預金先	626,200					
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	96.67%		

●2021年10月14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▲0.08~▲0.001%での調達で始まった。積み最終日の前日にあたり調達を控える先が多く、前日比でレート水準はやや低下した。一巡後は▲0.08~▲0.07%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、▲0.135~▲0.085%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市場は、複数件の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/10/14	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	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N		▲ 0.086	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.127	0.080	▲ 0.005	28,550.93	410.65	113.29-31	113.37-38
T/N				▲ 0.059				-	▲ 0.135						
S/N								-	-						
1W		▲ 0.002	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.114						
2W		▲ 0.045	▲ 0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.111						
3W		▲ 0.004	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.109						
1M		▲ 0.001	0.012	0.010				-	▲ 0.109						
3M								▲ 0.112	▲ 0.113						
6M								▲ 0.118	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.119	▲ 0.130						
日付		10/7	10/8	10/11	10/12	10/13									
日銀当預残		5,346,200	5,353,900	5,342,400	5,352,900	5,347,600									
準備預金残		4,737,600	4,767,900	4,756,200	4,743,500	4,727,100									
マネタリーベース		6,563,300	6,570,800	6,558,700	6,569,000	6,563,600									
無担O/N加重平均		▲0.009%	▲0.008%	▲0.021%	▲0.032%	▲0.040%									
コール市場残高		163,387	157,036	157,640	155,619	160,719									
うち無担		145,385	139,036	139,305	138,007	143,526									
うちO/N		66,022	62,723	62,532	61,214	67,053									
うち有担		18,002	18,000	18,335	17,612	17,193									

●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1非価格競争入札(億円)
5年利付国債	149	0.005%	25,000	2021/10/15	2026/9/20	77,939.0	20,188.0	100.4100	▲0.0770%	98.5189%	100.4200	▲0.0790%	4,803.0

●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)		2021/10/14	2021/10/15	▲ 0.350	91	91		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/14	2021/10/15	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月15日の予定

*月例経済報告	*米国9月の小売売上高	*国庫短期証券(1030回)入札
*8月の第3次産業活動指数	*米国8月の企業在庫	(3ヶ月、50,000億円、10/18発行)
	*米国10月のシシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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、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