

# Central Daily Market Report

2021年10月15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15日		2021年10月18日		2021年10月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		200		0	
財政	57,900		▲ 3,600		2,000	
資金過不足	58,000		▲ 3,400		2,000	
<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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 400	5,000	▲ 400		
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		100		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	57,400		1,300		2,000	
当座預金残高	5,415,700		5,417,000		5,419,000	
準備預金残高	4,809,300					
積み終了先	4,809,300					
超過準備	4,809,300					
非準備預金先	606,400					
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,735,100	
準備預金進捗率	実績	99.58%	日数	6.45%		

## ●2021年10月15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。積み最終日にあたる一方で次の積み期間にも掛かる取引となる事から、一巡後は▲0.07～▲0.06%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散見された。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.095～▲0.090%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(1030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やや堅調に推移した。

### ＜CP市場＞

CP市場は、入札件数が少なかったものの、大型発行が数件実施された。発行レートは、概ね横ばいであった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/10/15	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	▲ 0.047				-	▲ 0.085	0.075	▲ 0.005	29,068.63	517.70	113.83-84	114.09-10
T/N			▲ 0.059				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.001				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.016				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.010	0.010	0.003				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.118	▲ 0.113						
6M							▲ 0.118	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.130						
									日付	10/8	10/11	10/12	10/13	10/14
									日銀当預残	5,353,900	5,342,400	5,352,900	5,347,600	5,358,300
									準備預金残	4,767,900	4,756,200	4,743,500	4,727,100	4,732,100
									マネタリーベース	6,570,800	6,558,700	6,569,000	6,563,600	6,575,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.008%	▲ 0.021%	▲ 0.032%	▲ 0.040%	▲ 0.052%
									コール市場残高	157,036	157,640	155,619	160,719	171,593
									うち無担	139,036	139,305	138,007	143,526	152,472
									うちO/N	62,723	62,532	61,214	67,053	74,199
									うち有担	18,000	18,335	17,612	17,193	19,121

## ●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)
国庫短期証券	1030	-	50,000	2021/10/18	2022/1/24	207,134.0	40,613.0	100.0300	▲0.1117%	61.6980%	100.0315	▲0.1172%	9,386.0

## ●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)		2021/10/15	2021/10/18	▲ 0.350	55	55		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/15	2021/10/18	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年10月18日の予定

\*8月の石油等消費動態統計

\*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率

◆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