

# Central Daily Market Report

2021年10月22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22日		2021年10月25日		2021年10月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 600			0
財政	7,700		8,600			1,000
資金過不足	6,800		8,000			1,000
<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		▲ 100		▲ 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		▲ 200	800	▲ 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	▲ 200	500		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	6,800		8,500			1,000
当座預金残高	5,403,100		5,411,600			5,412,600
準備預金残高	4,750,300					
積み終了先	4,749,900				10月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,749,800				積数	3,200
非準備預金先	652,800				1日平均	100
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	99.91%	日数	29.03%		

## ●2021年10月22日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因で資金調達意欲が高まり、昨日よりやや高い水準での取引が中心となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.055~▲0.001%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.08~▲0.02%のレンジの出会いで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.090%程度での出会い。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(1033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底堅く推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/10/22	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.092	0.090	0.005	28,804.85	96.27	113.84-85	113.88-90
T/N	▲ 0.035	▲ 0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.006	▲ 0.003	▲ 0.005				-	▲ 0.099						
2W							-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.107	▲ 0.113						
6M							▲ 0.112	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.112	▲ 0.131						
									日付	10/15	10/18	10/19	10/20	10/21
									日銀当預残	5,415,700	5,418,500	5,422,600	5,386,200	5,396,300
									準備預金残	4,808,800	4,774,300	4,774,800	4,733,400	4,749,400
									マネタリーベース	6,632,500	6,635,200	6,639,400	6,604,200	6,615,400
									無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.039%	▲0.038%	▲0.036%	▲0.031%
									コール市場残高	160,141	176,886	183,011	188,863	195,767
									うち無担	140,288	159,214	165,509	171,660	178,692
									うちO/N	72,665	85,531	88,991	92,332	97,804
									うち有担	19,853	17,672	17,502	17,203	17,075

## ●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	1033	-	50,000	2021/10/25	2022/1/31	184,138.0	40,613.4	100.0285	▲0.1061%	89.6278%	100.0295	▲0.1098%	9,386.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/11/4	2022/5/9	463,673.0	11,000.42		0.0000%	2.3725%		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)	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)		2021/10/22	2021/10/25	▲ 0.350	220	220		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/22	2021/10/25	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年10月25日の予定

\*8月の景気動向指数改訂状況

\*流動性供給入札  
(5,000億円、10/26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