

Central Daily Market Report

2021年10月25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25日 | | 2021年10月26日 | | 2021年10月27日 | |
|-------------------------------|-------------|--------|-------------|-------|------------------|---------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | ▲ 700 | | ▲ 600 | | 0 | |
| 財政 | 5,800 | | ▲ 2,400 | | 4,000 | |
| 資金過不足 | 5,100 | | ▲ 3,000 | | 4,000 | |
| 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 | | | | | | ▲ 2,400 |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | | | | | | |
| CP等買入 | | ▲ 200 | | ▲ 700 | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | 800 | ▲ 300 | | | | |
| 新型コロナウイルス対応金融支援特別 | | | | | | |
| E T F買入 | | | | | | |
| 国債補充供給 | ▲ 200 | 200 | | 200 | | |
| <small>※ドル資金供給用担保確保供給</small> | | | | | | |
| 当預増減 | 5,400 | | ▲ 3,500 | | 1,600 | |
| 当座預金残高 | 5,408,500 | | 5,405,000 | | 5,406,600 | |
| 準備預金残高 | 4,758,300 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,757,900 | | | | 10月26日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,757,900 | | | | 積数 2,800 | |
| 非準備預金先 | 650,200 | | | | 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 | 99.93% | | 日数 | 32.26% | |

●2021年10月25日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落し、一部でレートを切り下げる動きが見られたものの、調達意欲は堅調で高止まりとなった。立ち上がりは邦銀・証券業態を中心に、▲0.07～▲0.001%の出合い。一巡後は▲0.07～▲0.015%で調達が見られた。ターム物はショートターム物の引き合いが見られた。

＜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発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

| 2021/10/25 | 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) | 為替(17時) |
| O/N | ▲ 0.070 | 0.001 | ▲ 0.027 | | | | - | ▲ 0.095 | 0.095 | 0.005 | 28,600.41 | ▲ 204.44 | 113.65-67 | 113.63-65 | |
| T/N | | | ▲ 0.033 | | | | - | ▲ 0.095 | | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | | |
| 1W | | | ▲ 0.001 | | | | - | ▲ 0.099 | | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.015 | ▲ 0.001 | ▲ 0.007 | | | | - | ▲ 0.099 | | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | | |
| 1M | | | ▲ 0.015 | | | | - | ▲ 0.107 | | | | | | | |
| 3M | | | 0.180 | | | | ▲ 0.107 | ▲ 0.113 | | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.112 | ▲ 0.120 | | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.111 | ▲ 0.130 | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | 日付 | 10/18 | 10/19 | 10/20 | 10/21 | 10/22 |
| | | | | | | | | | | 日銀当預残 | 5,418,500 | 5,422,600 | 5,386,200 | 5,396,300 | 5,403,100 |
| | | | | | | | | | | 準備預金残 | 4,774,300 | 4,774,800 | 4,733,400 | 4,749,400 | 4,750,300 |
| | | | | | | | | | | マネタリーベース | 6,635,200 | 6,639,400 | 6,604,200 | 6,615,400 | 6,623,100 |
| | | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.039% | ▲0.038% | ▲0.036% | ▲0.031% | ▲0.028% |
| | | | | | | | | | | コール市場残高 | 176,886 | 183,011 | 188,863 | 195,767 | 192,987 |
| | | | | | | | | | | うち無担 | 159,214 | 165,509 | 171,660 | 178,692 | 173,937 |
| | | | | | | | | | | うちO/N | 85,531 | 88,991 | 92,332 | 97,804 | 92,059 |
| | | | | | | | | | | うち有担 | 17,672 | 17,502 | 17,203 | 17,075 | 19,050 |

●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) |
|-------|-----|------|-------|------------|-----|----------|---------|-------|-------------|----------|--------|-------------|---------------|
| 流動性供給 | 344 | - | 5,000 | 2021/10/26 | | 11,183.0 | 4,981.0 | | 0.0090% | 54.7058% | | 0.0070% | |

●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 |
|---------------------------|----------------|------------|------------|---------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2021/10/25 | 2021/10/26 | ▲ 0.350 | 197 | 197 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2021/10/25 | 2021/10/26 | ▲ 0.350 | 0 | 0 | | | | |

●2021年10月26日の予定

| | |
|------------------|-------------------------|
| *9月の企業向けサービス価格指数 | *米国8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 |
| | *米国9月の新築一戸建て販売件数 |
| | *米国10月のCB消費者信頼感指数 |

◆本資料は信頼できるとさ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