

# Central Daily Market Report

2021年10月26日(火)

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26日		2021年10月27日		2021年10月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 2,000		500		2,000	
資金過不足	▲ 2,600		▲ 300		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			2,400	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入			9,500			
CP等買入		▲ 700		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 47,200
E T F買入						
国債補充供給	▲ 200	200		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
<b>当預増減</b>	▲ 3,300		10,200		▲ 46,200	
当座預金残高	5,405,200		5,415,400		5,369,200	
準備預金残高	4,757,000					
積み終了先	4,756,600		10月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,756,600		積数		2,400	
非準備預金先	648,200		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	99.94%	日数	35.48%		

## ●2021年10月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き調達意欲は強く、レートは横ばい圏で推移。立ち上がりは国内勢を中心に、▲0.065~▲0.001%の出会い。一巡後は▲0.06~▲0.015%で調達が見られ本日の取引を終えた。ターム物は目立った出会いは見られなかった。

### <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>

26日は短国買入オベが前回と同額(1,000億円)でオファーされ、弱めの結果となった。応札倍率が引き続き高く、売却需要の高まりが意識される結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、特段の出会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。本日はCP等買入オベが事前予定通り5,000億円でオファーされた。結果は平均落札レート▲0.012%、按分レート▲0.015%と前日比で平均は低下し、按分は横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/10/26	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.094	0.100	0.005	29,106.01	505.60	113.76-77	114.04-05
T/N			▲ 0.033				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.098						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.107	▲ 0.113						
6M							▲ 0.112	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.111	▲ 0.130						
									日付	10/19	10/20	10/21	10/22	10/25
									日銀当預残	5,422,600	5,386,200	5,396,300	5,403,100	5,408,500
									準備預金残	4,774,800	4,733,400	4,749,400	4,750,300	4,758,100
									マネタリーベース	6,639,400	6,604,200	6,615,400	6,623,100	6,629,200
									無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.036%	▲0.031%	▲0.028%	▲0.027%
									コール市場残高	183,011	188,863	195,767	192,987	192,472
									うち無担	165,509	171,660	178,692	173,937	174,774
									うちO/N	88,991	92,332	97,804	92,059	91,596
									うち有担	17,502	17,203	17,075	19,050	17,698

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2021/10/27	2021/11/10		2,361	2,361				
国庫短期証券買入	1,000	2021/10/27			9,477	1,000		0.008	0.008	
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/10/27			12,914	4,506	0.006		0.007	25.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/10/27			9,264	4,261	0.005		0.005	77.7
国債買入(物価連動債)	600	2021/10/27			2,249	603	0.040		▲0.027	33.7
CP等買入	5,000	2021/10/29			7,257	4,969	▲0.015		▲0.012	55.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/10/26	2021/10/27	▲ 0.350	188	188		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/26	2021/10/27	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/10/28	2021/11/4	0.330	0	0				

## ●2021年10月27日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、28日まで)	*米国9月の耐久財新規受注	*2年利付国債入札(30,000億円、11/1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