

Central Daily Market Report

2021年10月5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5日		2021年10月6日		2021年10月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		200		0	
財政	1,000		▲ 26,500		5,000	
資金過不足	1,800		▲ 26,300		5,000	
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			1,000			
国債買入	10,700					
CP等買入		▲ 100				
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						
E T F 買入						
国債補完供給		100				
米ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	12,500		▲ 25,300		5,000	
当座預金残高	5,368,400		5,343,100		5,348,100	
準備預金残高	4,740,400					
積み終了先	4,740,400				10月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,740,400				積数	100
非準備預金先	628,000				1日平均	0
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額						3,615,500
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	66.67%		

●2021年10月5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▲0.035~▲0.001%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られた。ターム物に関しては、1~2W物の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、▲0.085~▲0.075%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>

本日は短国買入オベが前回と同額(1,000億円)でオファーされ、やや弱めの結果となった。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

2021/10/5	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.083	0.060	0.015	27,822.12	▲ 622.77	110.95-97	111.09-10
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	0.001	0.000				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.020	▲ 0.002	▲ 0.016				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.092						
1M	▲ 0.009	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.134	▲ 0.109						
6M							▲ 0.122	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.131						
									日付	9/28	9/29	9/30	10/1	10/4
									日銀当預残	5,429,200	5,418,000	5,416,700	5,397,900	5,355,900
									準備預金残	4,791,400	4,800,300	4,806,100	4,792,400	4,753,200
									マネタリーベース	6,646,800	6,636,000	6,634,900	6,616,200	6,573,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.025%	▲ 0.025%	▲ 0.049%	▲ 0.018%	▲ 0.017%
									コール市場残高	181,221	168,105	119,971	159,983	154,662
									うち無担	163,865	149,834	103,650	142,713	136,189
									うちO/N	75,962	62,111	53,702	69,555	58,876
									うち有担	17,356	18,271	16,321	17,270	18,473

●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非償格募入札(億円)	非償格入札(億円)
10年利付国債	364	0.100%	26,000	2021/10/6	2031/9/20	51,446.0	20,978.0	100.4700	0.0520%	78.6986%	100.5000	0.0490%	4,991	22.75
交付税特会	-	-	11,000	2021/10/15	2022/4/15	451,609.0	11,000.36		0.0000%	2.4359%		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
国庫短期証券買入	1,000	2021/10/6			9,483	1,000		0.007	0.007	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/10/5	2021/10/6	▲ 0.350	12	12		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/5	2021/10/6	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/10/7	2021/10/14	0.330	1	1				

●2021年10月6日の予定

特にありません。

◆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