Central Daily Market Report

2021年10月12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12日 需給速報		2021年10月13日 需給予想		2021年10月14日 当社予想	
銀行券	200		100		▲ 1,000	
財政	10,300		▲ 6,300		▲ 1,000	
資金過不足	10,500		▲ 6,200		▲ 2,000	
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			2,400	▲ 4,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	10,500		▲ 6,900		▲ 2,000	

当座預金残高	5,352,900	5,346,000	5,344,000
準備預金残高	4,743,500		
積み終了先	4,743,500		
超過準備	4,743,500		
非準備預金先	609,400		

10月13日以降の残り所要積立額	
積数	0
1日平均	0

積み期間（9/16～10/15）の所要準備額			3,615,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 90.00%

●2021年10月12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▲0.07～▲0.001%での調達で始まった。積みに目途のついた先も多く、レート水準は前日比で低下した。一巡後は▲0.065～▲0.04%程度の出合いが見られた。ターム物に関しては、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、▲0.115～▲0.085%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>
本日は短国買入オペが前回と同額でオファーされ、弱めの結果となった。マーケット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市場は、大型を含めて複数の入札が実施された。発行レートは、概ね同水準で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/10/12	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.032				－	▲ 0.088
T/N							－	▲ 0.092
S/N							－	－
1W			▲ 0.003				－	▲ 0.092
2W			▲ 0.002				－	▲ 0.095
3W							－	▲ 0.097
1M	▲ 0.008	▲ 0.002	▲ 0.003				－	▲ 0.101
3M							▲ 0.110	▲ 0.110
6M							▲ 0.118	▲ 0.120
1Y							▲ 0.119	▲ 0.130

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.090	0.000	28,230.61	▲ 267.59	113.38-39	113.29-30

日付	10/5	10/6	10/7	10/8	10/11
日銀当預残	5,368,400	5,343,100	5,346,200	5,353,900	5,342,400
準備預金残	4,740,400	4,740,100	4,737,600	4,767,900	4,756,200
マネタリーベース	6,585,500	6,559,900	6,563,300	6,570,800	6,558,700
無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.012%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.021%
コール市場残高	156,193	157,144	163,387	157,036	157,640
うち無担	137,707	139,087	145,385	139,036	139,305
うちO/N	58,744	60,274	66,022	62,723	62,532
うち有担	18,486	18,057	18,002	18,000	18,335

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
30年利付国債	72	0.700%	9,000	2021/10/13	2051/9/20	21,241.0	7,314.00	99.8500	**0.7060%**	**32.0181%**	99.9400	**0.7020%**	1,679.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2021/10/13	2021/10/27		2,351	2,351				
国庫短期証券買入	1,000	2021/10/13			9,764	1,000		0.010	0.010	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/10/12	2021/10/13	▲ 0.350	17	17		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/10/12	2021/10/13	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/10/14	2021/10/21	0.330	0	0				

●2021年10月13日の予定

*8月の機械受注統計
　市場予想：船舶・電力除く民需、前月比＋1.7%
*9月のマネーストック
*米国9月の財政収支
*米国9月の消費者物価指数
*交付税特別会計借入
（11,000億円、10/22借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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