Central Daily Market Report

2021年10月18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18日 需給速報		2021年10月19日 需給予想		2021年10月20日 当社予想	
銀行券	100		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 2,000		5,400		▲ 37,000	
資金過不足	▲ 1,900		5,300		▲ 38,000	
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						
国債買入						
CP等買入	5,000	▲ 400		▲ 300		
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	2,800		5,000		▲ 38,000	

当座預金残高	5,418,500	5,423,500	5,385,500
準備預金残高	4,774,300		
積み終了先	4,772,700		
超過準備	4,765,400		
非準備預金先	644,200		

10月19日以降の残り所要積立額	
積数	6,900
1日平均	200

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	99.82%	日数	9.68%

●2021年10月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積みが始まって最初の営業日という事で多くの先からビッドが入った一方、前積み期終盤のレート低下を受けてレート目線を引き下げている先も見られたことから、幅広いレンジで出合う展開となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.075～▲0.001%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.075～▲0.03%のレンジの出合いで推移した。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%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

2021/10/18	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	▲ 0.078	0.001	▲ 0.039				－	▲ 0.093
T/N			▲ 0.045				－	▲ 0.097
S/N							－	－
1W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.008				－	▲ 0.099
2W	▲ 0.060	▲ 0.003	▲ 0.035				－	▲ 0.102
3W							－	▲ 0.103
1M	▲ 0.020	0.001	▲ 0.004				－	▲ 0.105
3M			0.015				▲ 0.118	▲ 0.114
6M							▲ 0.118	▲ 0.121
1Y							▲ 0.119	▲ 0.131

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	0.015	29,025.46	▲ 43.17	114.33-34	114.29-30

日付	10/11	10/12	10/13	10/14	10/15
日銀当預残	5,342,400	5,352,900	5,347,600	5,358,300	5,415,700
準備預金残	4,756,200	4,743,500	4,727,100	4,732,100	4,808,800
マネタリーベース	6,558,700	6,569,000	6,563,600	6,575,200	6,632,500
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.032%	▲0.040%	▲0.052%	▲0.046%
コール市場残高	157,640	155,619	160,719	171,593	160,141
うち無担	139,305	138,007	143,526	152,472	140,288
うちO/N	62,532	61,214	67,053	74,199	72,665
うち有担	18,335	17,612	17,193	19,121	19,853

●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Ｉ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/10/18	2021/10/19	▲ 0.350	16	16		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/10/18	2021/10/19	▲ 0.350	0	0				

●2021年10月19日の予定

*米国9月の住宅着工件数

*国庫短期証券（1031回）入札
（1年、35,000億円、10/20発行）

*20年利付国債入札
（12,000億円、10/20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