Central Daily Market Report

2021年10月28日（木）
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28日 需給速報		2021年10月29日 需給予想		2021年11月1日 当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 300		0	
財政	800		▲ 8,100		▲ 18,000	
資金過不足	▲ 800		▲ 8,400		▲ 18,000	
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		▲ 100	5,000	▲ 3,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別	58,200	▲ 47,200				
ＥＴＦ買入			800			
国債補完供給	▲ 300	500		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	10,200		▲ 5,800		▲ 18,000	

当座預金残高	5,424,100	5,418,300	5,400,300
準備預金残高	4,770,800		
積み終了先	4,770,500		
超過準備	4,770,500		
非準備預金先	653,300		

10月29日以降の残り所要積立額	
積数	1,700
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 99.95%	日数 41.94%

●2021年10月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態を中心に、▲0.07～▲0.001%での調達で始まった。一巡後は▲0.06～▲0.015%のレンジの出合いが見られ、本日の取引を終えた。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、▲0.11～▲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>

28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、一部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。

●入札結果

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。

●2021年10月29日の予定

*9月の完全失業率(市場予想:2.8%)　*9月の有効求人倍率(市場予想:1.14倍)
*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲3.2%)　*9月の住宅着工統計
*10月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)＋0.3%)
*10月の消費動向調査
*米国9月の個人所得・消費支出　　*米国10月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏7-9月期のGDP1次速報　*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値
*国庫短期証券(1034回)入札(3ヶ月、50,000億円、11/1発行)
*交付税特別会計借入(11,000億円、11/10借入)

●短期金融市場関連指標

2021/10/28	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	▲ 0.027				－	▲ 0.102
T/N			▲ 0.035				－	▲ 0.111
S/N							－	－
1W	▲ 0.008	0.050	0.000				－	▲ 0.104
2W	▲ 0.035	▲ 0.009	▲ 0.018				－	▲ 0.102
3W			▲ 0.004				－	▲ 0.102
1M	▲ 0.017	0.001	▲ 0.007				－	▲ 0.106
3M							▲ 0.107	▲ 0.112
6M							▲ 0.112	▲ 0.120
1Y							▲ 0.111	▲ 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)
0.085	▲ 0.010	28,820.09	▲ 278.15	113.77-79	113.60-61

日付	10/21	10/22	10/25	10/26	10/27
日銀当預残	5,396,300	5,403,100	5,408,500	5,405,200	5,413,900
準備預金残	4,749,400	4,750,300	4,758,100	4,757,000	4,767,000
マネタリーベース	6,615,400	6,623,100	6,629,200	6,626,600	6,636,100
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.028%	▲0.027%	▲0.026%	▲0.027%
コール市場残高	195,767	192,987	192,472	189,337	186,509
うち無担	178,692	173,937	174,774	172,049	169,503
うちO/N	97,804	92,059	91,596	90,879	88,033
うち有担	17,075	19,050	17,698	17,288	17,006

●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)		2021/10/28	2021/10/29	▲ 0.350	305	305		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/10/28	2021/10/29	▲ 0.350	0	0				

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定。

（1）長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）（賛成8反対1）

次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

（2）資産買入れ方針（全員一致）

長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。

①ETFおよびJ-REITについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。

②CP等、社債等については、2022年3月末までの間、合計で約20兆円の残高を上限に、買入れを行う。

2. 日本銀行は、2%の「物価安定の目標」の実現を目指し、これを安定的に持続するために必要な時点まで、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続する。

マネタリーベースについては、消費者物価指数（除く生鮮食品）の前年比上昇率の実績値が安定的に2%を超えるまで、拡大方針を継続する。

引き続き、①新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム、②国債買入れやドルオペなどによる円貨および外貨の上限を設けない潤沢な供給、③それぞれ約12兆円および約1,800億円の年間増加ペースの上限のもとでのETFおよびJ-REITの買入れにより、企業等の資金繰り支援と金融市場の安定維持に努めていく。

当面、新型コロナウイルス感染症の影響を注視し、必要があれば、躊躇なく追加的な金融緩和措置を講じる。政策金利については、現在の長短金利の水準、または、それを下回る水準で推移することを想定している.

◆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