

Central Daily Market Report

2021年9月1日(水)

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9月1日 需給速報	2021年9月2日 需給予想	2021年9月3日 当社予想
銀行券	100	▲ 400	0
財政	▲ 36,700	▲ 20,400	▲ 22,000
資金過不足	▲ 36,600	▲ 20,800	▲ 22,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	2,400	▲ 3,400	
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			
貸出支援基金(成)	5,000	▲ 3,200	
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			
国債補充供給			
※ドル資金供給用担保提供			
当預増減	▲ 34,800	▲ 20,800	▲ 22,000
当座預金残高	5,358,300	5,337,500	5,315,500
準備預金残高	4,696,800		
積み終了先	4,696,500		
超過準備	4,696,500		
非準備預金先	661,500		
9月2日以降の残り所要積立額			
積数			500
1日平均			0
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			3,739,200
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			54.84%

●2021年9月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は積み込みの後半に入り、一部の先より取り上がる動きが見られ、立ち上がりは▲0.06~▲0.02%の出合い。一巡後も▲0.06~▲0.02%台の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は1~2W物を中心に引き合いが見られた。

<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、一部で大型発行も見られたが案件は少なかった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/9/1	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.081	0.025	0.005	28,451.02	361.48	110.05-06	110.39-41
T/N			▲ 0.028				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.025	▲ 0.037				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.025	▲ 0.003	▲ 0.019				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.120	▲ 0.111						
6M							▲ 0.132	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130						
									日付	8/25	8/26	8/27	8/30	8/31
									日銀当預残	5,346,100	5,374,400	5,361,700	5,377,400	5,393,100
									準備預金残	4,652,200	4,687,700	4,694,200	4,705,700	4,717,100
									マネタリーベース	6,564,900	6,594,400	6,582,300	6,598,300	6,613,400
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.036%	▲0.036%
									コール市場残高	161,263	162,144	165,574	149,636	141,497
									うち無担	143,069	144,391	147,395	132,980	123,375
									うちO/N	77,466	77,643	79,927	68,812	61,517
									うち有担	18,194	17,753	18,179	16,656	18,122

●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	業分率	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/1	2021/9/2	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/1	2021/9/2	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月2日の予定

*片岡日銀審議委員、
長崎県金融経済懇談会にて講演
*8月実績/9月見込み財政資金対民間収支
*8月のマネタリーベース

*米国7月の貿易収支
*米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫

*10年利付国債入札
(26,000億円、9/3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