

Central Daily Market Report

2021年9月2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9月2日		2021年9月3日		2021年9月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		500		1,000	
財政	▲ 19,900		▲ 33,300		13,000	
資金過不足	▲ 20,200		▲ 32,800		14,000	
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						
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		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給						
※ドル資金供給用担保提供						
当増減	▲ 20,200		▲ 32,900		14,000	
当座預金残高	5,338,100		5,305,200		5,319,200	
準備預金残高	4,707,700					
積み終了先	4,707,600					
超過準備	4,707,300					
非準備預金先	630,400					
9月3日以降の残り所要積立額						
積数					200	
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	58.06%		

●2021年9月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、全般的に取り上がる展開で、国内勢を中心に▲0.045~▲0.01%の出会い。一巡後は▲0.06~▲0.02%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.075~▲0.07%程度での出会い。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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から大口発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/9/2	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.076	0.029	0.004	28,543.51	92.49	110.09-10	110.00-02
T/N							-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.053	▲ 0.010	▲ 0.038				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.120	▲ 0.109						
6M							▲ 0.132	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130						
									日付	8/26	8/27	8/30	8/31	9/1
									日銀当預残	5,374,400	5,361,700	5,377,400	5,393,100	5,358,300
									準備預金残	4,687,700	4,694,200	4,705,700	4,717,100	4,695,600
									マネタリーベース	6,594,400	6,582,300	6,598,300	6,613,400	6,578,500
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.037%	▲0.036%	▲0.036%	▲0.032%
									コール市場残高	162,144	165,574	149,636	141,497	142,478
									うち無担	144,391	147,395	132,980	123,375	123,757
									うちO/N	77,643	79,927	68,812	61,517	61,069
									うち有担	17,753	18,179	16,656	18,122	18,721

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	363	0.10%	26,000	2021/9/3	2031/6/20	70,926.0	21,127.00	100.7300	0.0250%	77.9744%	100.7500	0.0230%	4,846.0	12.80

●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)		2021/9/2	2021/9/3	▲ 0.350	6	6		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/2	2021/9/3	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年9月3日の予定

*9月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国8月の雇用統計 *米国8月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(1020回)入札 (3ヶ月、50,000億円、9/6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