

Central Daily Market Report

2021年9月3日(金)

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3日 需給速報	2021年9月6日 需給予想	2021年9月7日 当社予想
銀行券	600	800	1,000
財政	▲ 37,700	12,200	0
資金過不足	▲ 37,100	13,000	1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		10,700	
CP等買入			▲ 200
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	▲ 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開始			
当預増減	▲ 37,200	23,400	1,000
当座預金残高	5,300,900	5,324,300	5,325,300
準備預金残高	4,672,000		
積み終了先	4,672,000		9月6日以降の残り所要積立額
超過準備	4,672,000		積数
非準備預金先	628,900		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	100.00%	日数
			67.74%

●2021年9月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、レート上昇基調のなかで、3日積み要因が重なり、取り上がりの展開となった。立ち上がりは国内勢を中心に▲0.04~▲0.01%の出合い。一巡後は▲0.06~▲0.01%の出合いが見られた。ターム物はショートターム物の引き合いが散見された程度であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.075~▲0.065%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TB3M物(1020回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは底堅く推移した。

<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

2021/9/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.073	0.035	0.006	29,128.11	584.60	109.95-96	110.03-04
T/N							-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.014				-	▲ 0.080						
2W							-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.090						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.120	▲ 0.109						
6M							▲ 0.132	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130						
									日付	8/27	8/30	8/31	9/1	9/2
									日銀当預残	5,361,700	5,377,400	5,393,100	5,358,300	5,338,100
									準備預金残	4,694,200	4,705,700	4,717,100	4,695,600	4,707,700
									マネタリーベース	6,582,300	6,598,300	6,613,400	6,578,500	6,558,600
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.036%	▲0.036%	▲0.032%	▲0.026%
									コーポ市場残高	165,574	149,636	141,497	142,478	141,266
									うち無担	147,395	132,980	123,375	123,757	122,614
									うちO/N	79,927	68,812	61,517	61,069	60,391
									うち有担	18,179	16,656	18,122	18,721	18,652

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1020	-	50,000	2021/9/6	2021/12/6	182,633.9	40,618.4	100.0285	▲0.1142%	6.8248%	100.0298	▲0.1194%	9,381.0

●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)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均貸付レート・利回差・価格差	貸付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/9/6			11,702	4,509	0.003		0.004	98.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/9/6			11,946	4,504	0.000		0.001	82.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2021/9/6			3,132	1,510	0.005		0.006	54.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/3	2021/9/6	▲ 0.350	22	22		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/3	2021/9/6	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月6日の予定

*New York祝日(Labor Day)

◆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