

Central Daily Market Report

2021年9月6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9月6日 需給速報		2021年9月7日 需給予想		2021年9月8日 当社予想	
銀行券	800		900		0	
財政	7,700		2,300		▲13,000	
資金過不足	8,500		3,200		▲13,000	
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	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		▲200		
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供給						
当増減	18,900		3,000		▲13,000	
当座預金残高	5,319,800		5,322,800		5,309,800	
準備預金残高	4,684,900					
積み終了先	4,684,900					
超過準備	4,684,900					
非準備預金先	634,900					
9月7日以降の残り所要積立額						
積数					100	
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	70.97%		

●2021年9月6日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀を中心に▲0.035~▲0.008%の調達で始まった。先週末の強い地合いを引き継ぎ、前営業日比でレートは上昇した。レート上昇余地が限られる中、アマウントを確保する動きが先行した。ターム物はオファーが出難く、目立った出合いは見られなかった。

<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市場は、入札が少なく閑散としていた。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/9/6	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	▲0.018				-	▲0.070	0.040	0.005	29,659.89	531.78	109.76-78	109.89-91
T/N							-	▲0.070						
S/N							-	-						
1W	▲0.040	0.001	▲0.022				-	▲0.077						
2W	▲0.030	▲0.003	▲0.027				-	▲0.082						
3W			▲0.004				-	▲0.090						
1M							-	▲0.099						
3M							▲0.120	▲0.109						
6M							▲0.128	▲0.121						
1Y							▲0.129	▲0.130						
									日付	8/30	8/31	9/1	9/2	9/3
									日銀当預残	5,377,400	5,393,100	5,358,300	5,338,100	5,300,900
									準備預金残	4,705,700	4,717,100	4,695,600	4,707,700	4,672,000
									マネタリーベース	6,598,300	6,613,400	6,578,500	6,558,600	6,520,900
									無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.036%	▲0.032%	▲0.026%	▲0.020%
									コール市場残高	149,636	141,497	142,478	141,266	141,529
									うち無担	132,980	123,375	123,757	122,614	122,953
									うちO/N	68,812	61,517	61,069	60,391	60,600
									うち有担	16,656	18,122	18,721	18,652	18,576

●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)		2021/9/6	2021/9/7	▲0.350	48	48		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/6	2021/9/7	▲0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/9/9			2,230	1,250	▲0.062		▲0.051	4.2

●2021年9月7日の予定

- *7月の全世帯家計調査
- *7月の毎月勤労統計調査速報
- *7月の景気動向指数速報
- *8月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *ユーロ圏4-6月期のGDP確報値
- *30年利付国債入札(9,000億円、9/8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