Central Daily Market Report

2021年9月7日（火）
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7日 需給速報		2021年9月8日 需給予想		2021年9月9日 当社予想	
銀行券	900		700		0	
財政	▲ 400		▲ 13,400		2,000	
資金過不足	500		▲ 12,700		2,000	
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			1,000			
国債買入						
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200			1,300	
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	200		▲ 11,700		3,300	
当座預金残高	5,320,000		5,308,300		5,311,600	
準備預金残高	4,670,000					
積み終了先	4,670,000					
超過準備	4,670,000					
非準備預金先	650,000					
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額					3,736,800	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数		74.19%	

9月8日以降の残り所要積立額	
積数	100
1日平均	0

●2021年9月7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▲0.025～▲0.005%の調達で始まった。取引開始時から▲0.01%に取り手が並ぶ展開となり、調達ニーズが強い先ではさらに取り上がる動きも見られた。全体の調達希望額に対しオファー額が少なく、本日も取り残る先が複数見られた。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>

本日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱めの結果となった。引き続き応札倍率が高く、売却需要の強さが意識された。マーケット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、9月末越え物を中心に数件の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/9/7	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.014				－	▲ 0.071
T/N							－	▲ 0.071
S/N							－	－
1W	▲ 0.012	0.250	0.037				－	▲ 0.075
2W	▲ 0.028	▲ 0.020	▲ 0.025				－	▲ 0.082
3W			▲ 0.015				－	▲ 0.091
1M			0.000				－	▲ 0.100
3M							▲ 0.119	▲ 0.109
6M							▲ 0.128	▲ 0.121
1Y							▲ 0.128	▲ 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)
0.035	▲ 0.005	29,916.14	256.25	109.82-83	109.89-90

日付	8/31	9/1	9/2	9/3	9/6
日銀当預残	5,393,100	5,358,300	5,338,100	5,300,900	5,319,800
準備預金残	4,717,100	4,695,600	4,707,700	4,672,000	4,684,900
マネタリーベース	6,613,400	6,578,500	6,558,600	6,520,900	6,539,000
無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.032%	▲0.026%	▲0.020%	▲0.018%
コール市場残高	141,497	142,478	141,266	141,529	137,079
うち無担	123,375	123,757	122,614	122,953	118,430
うちO/N	61,517	61,069	60,391	60,600	55,827
うち有担	18,122	18,721	18,652	18,576	18,649

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
30年利付国債	71	0.700%	9,000	2021/9/8	2051/6/20	21,935.0	7,311.00	101.1000	**0.6550%**	**71.9741%**	101.1700	**0.6530%**	1,677.0

●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）	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
国庫短期証券買入	1,000	2021/9/8			9,578	1,000		0.007	0.008	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/9/7	2021/9/8	▲ 0.350	133	133		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/9/7	2021/9/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/9/9	2021/9/16	0.330	0	0				

●2021年9月8日の予定

*4-6月期のGDP2次速報（市場予想：前期比年率＋1.6%）
*7月の国際収支
*7月の特定サービス産業動態統計速報
*8月の景気ウォッチャー調査
*米国ベージュブック
*米国7月の消費者信用残高

◆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