

Central Daily Market Report

2021年9月8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8日		2021年9月9日		2021年9月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		200		0	
財政	▲ 12,600		▲ 1,000		▲ 31,000	
資金過不足	▲ 11,900		▲ 800		▲ 31,000	
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			10,300			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			1,300			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 10,900		10,400		▲ 31,000	
当座預金残高	5,309,100		5,319,500		5,288,500	
準備預金残高	4,674,900					
積み終了先	4,674,900		9月9日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,674,900		積数		100	
非準備預金先	634,200		1日平均		0	
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	77.42%		

●2021年9月8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▲0.015~▲0.002%の調達で始まった。本日も全般的に調達ニーズが強く、アマウント確保を優先し取り上がる動きが大勢であったが、それでも取り残る先が複数見られた。加重平均レートは今月に入り、日を追う毎に上昇を続けている。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲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市場は、複数の業態から発行が実施されたものの、小ロットが中心であった。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

2021/9/8	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	
	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.072	0.040	0.005	30,181.21	265.07	110.29-30	110.24-25
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.078						
2W	▲ 0.017	▲ 0.003	▲ 0.016				-	▲ 0.084						
3W			0.000				-	▲ 0.092						
1M			0.000				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.119	▲ 0.109						
6M							▲ 0.128	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.130						
									日付	9/1	9/2	9/3	9/6	9/7
									日銀当預残	5,358,300	5,338,100	5,300,900	5,319,800	5,320,000
									準備預金残	4,695,600	4,707,700	4,672,000	4,684,900	4,670,000
									マネタリーベース	6,578,500	6,558,600	6,520,900	6,539,000	6,538,300
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.026%	▲0.020%	▲0.018%	▲0.014%
									コール市場残高	142,478	141,266	141,529	137,079	137,511
									うち無担	123,757	122,614	122,953	118,430	119,120
									うちO/N	61,069	60,391	60,600	55,827	55,397
									うち有担	18,721	18,652	18,576	18,649	18,391

●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	案分率	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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/9/9			1,949	1,501	▲0.005		0.002	11.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/9/9			10,371	4,505	0.000		0.000	96.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/9/9			10,695	4,264	0.006		0.007	14.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/8	2021/9/9	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/8	2021/9/9	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月9日の予定

*8月のマネーストック	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(1021回)入札 (6ヶ月、34,000億円、9/10発行)
		*5年利付国債入札 (25,000億円、9/10発行)

◆本資料は信頼できるとさ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