

Central Daily Market Report

2021年9月9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9日		2021年9月10日		2021年9月13日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	200	800				1,000
財政	▲ 800	▲ 38,500				8,000
資金過不足	▲ 600	▲ 37,700				9,000
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	10,300					
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	10,600	▲ 38,100				9,000
当座預金残高	5,319,700		5,281,600			5,290,600
準備預金残高	4,671,000					
積み終了先	4,671,000				9月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,671,000				積数	100
非準備預金先	648,700				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			80.65%

●2021年9月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.01~▲0.002%の調達で始まった。引き続き調達ニーズが強く、レートは前日比で上昇した。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、▲0.065~▲0.08%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>

本日はTB6M物(1021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市場は、少額発行が中心であったものの、複数の業態から調達が発行された。発行レートは、前回比で概ね同水準であった。

●短期金融市場関連指標

2021/9/9	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	売買取引値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.074	0.035	▲ 0.005		30,008.19	▲ 173.02	110.21-23	109.95-96
T/N							-	▲ 0.077							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.079							
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.086							
3W			0.150				-	▲ 0.092							
1M			0.016				-	▲ 0.100							
3M							▲ 0.119	▲ 0.109							
6M							▲ 0.119	▲ 0.120							
1Y							▲ 0.125	▲ 0.130							
										日付	9/2	9/3	9/6	9/7	9/8
										日銀当預残	5,338,100	5,300,900	5,319,800	5,320,000	5,309,100
										準備預金残	4,707,700	4,672,000	4,684,900	4,670,000	4,673,800
										マネタリーベース	6,558,600	6,520,900	6,539,000	6,538,300	6,526,700
										無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.020%	▲0.018%	▲0.014%	▲0.009%
										コール市場残高	141,266	141,529	137,079	137,511	135,608
										うち無担	122,614	122,953	118,430	119,120	117,462
										うちO/N	60,391	60,600	55,827	55,397	52,999
										うち有担	18,652	18,576	18,649	18,391	18,146

●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)
国庫短期証券	1021	-	34,000	2021/9/10	2022/3/10	100,015.0	27,630.5	100.0580	▲0.1168%	78.3200%	100.0590	▲0.1189%	6,369.0
5年利付国債	148	0.005%	25,000	2021/9/10	2026/6/20	89,720.0	20,313.00	100.5100	▲0.1010%	7.4346%	100.5200	▲0.1030%	4,687.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/9	2021/9/10	▲ 0.350	47	47		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/9	2021/9/10	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月10日の予定

*米国7月の卸売売上高	*国庫短期証券(1022回)入札(3ヶ月、50,000億円、9/13発行)	*エネルギー対策借入(6,000億円、9/21借入)
*米国8月の生産者物価指数		

◆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