

# Central Daily Market Report

2021年9月10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10日		2021年9月13日		2021年9月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		400		0	
財政	▲ 39,500		6,400		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 38,600		6,800		▲ 2,000	
<b>金融調節</b>						
	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						
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200		200			
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 39,200		6,800		▲ 2,000	
当座預金残高	5,280,500		5,287,300		5,285,300	
準備預金残高	4,692,100					
積み終了先	4,692,100		9月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,692,100		積数	0		
非準備預金先	588,400		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	90.32%		

## ●2021年9月10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~▲0.001%の調達で始まった。一巡後は散発的に▲0.07~▲0.03%の出会いも見られた。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、▲0.075~▲0.060%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TB3M物(1022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。この他に、6M物に出合いが見られた。

### ＜CP市場＞

CP市場は、数件の入札が実施された。発行レートは、期越え物で低位横ばい。CP等買入オペの結果は、平均レート▲0.013%、按分レート▲0.016%と前回比でいずれも低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/9/10	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	▲ 0.010				-	▲ 0.068	0.040	0.005	30,381.84	373.65	109.76-78	109.94-96
T/N							-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.078						
2W							-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.093						
1M			0.000				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.119	▲ 0.108						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.130						
									日付	9/3	9/6	9/7	9/8	9/9
									日銀当預残	5,300,900	5,319,800	5,320,000	5,309,100	5,319,700
									準備預金残	4,672,000	4,684,900	4,670,000	4,673,800	4,671,000
									マネタリーベース	6,520,900	6,539,000	6,538,300	6,526,700	6,537,100
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.018%	▲0.014%	▲0.009%	▲0.006%
									コール市場残高	141,529	137,079	137,511	135,608	155,450
									うち無担	122,953	118,430	119,120	117,462	137,054
									うちO/N	60,600	55,827	55,397	52,999	71,391
									うち有担	18,576	18,649	18,391	18,146	18,396

## ●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	1022	-	50,000	2021/9/13	2021/12/13	168,449.0	40,618.4	100.0280	▲0.1122%	44.1559%	100.0293	▲0.1174%	9,381.0
エネルギー対策	-	-	6,000	2021/9/21	2022/9/20	184,664.0	5,999.73		0.0000%	3.2491%		0.0000%	

## ●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	入札総額(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
CP等買入	5,000	2021/9/15			9,995	4,992	▲0.016		▲0.013	68.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/10	2021/9/13	▲0.350	170	170		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/10	2021/9/13	▲0.350	0	0				

## ●2021年9月13日の予定

\*7-9月期の法人企業景気予測調査季報  
\*8月の企業物価指数

\*米国8月の財政収支

◆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