

# Central Daily Market Report

2021年9月13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13日		2021年9月14日		2021年9月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		800			0
財政	1,900		7,300			▲ 6,000
資金過不足	2,200		8,100			▲ 6,000
<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						▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200			5,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					27,700	▲ 33,800
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 700	200		700		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	1,500		8,800			▲ 9,500
当座預金残高	5,282,000		5,290,800			5,281,300
準備預金残高	4,677,400					
積み終了先	4,677,400				9月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,677,400				積数	0
非準備預金先	604,600				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	93.55%		

## ●2021年9月13日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.05～▲0.002%の調達で始まった。一巡後は▲0.055～▲0.015%程度の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.070～▲0.060%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＞

本日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

### ＜CP市場＞

CP市場は複数の入札が実施された。発行レートは引き続き期越え物で低位横ばい。

## ●短期金融市場関連指標

2021/9/13	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.066	0.040	0.000	30,447.37	65.53	109.92-93	110.08-09
T/N							-	▲ 0.065						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.079						
2W							-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.119	▲ 0.108						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.130						
									日付	9/6	9/7	9/8	9/9	9/10
									日銀当預残	5,319,800	5,320,000	5,309,100	5,319,700	5,280,500
									準備預金残	4,684,900	4,670,000	4,673,800	4,671,000	4,690,600
									マネタリーベース	6,539,000	6,538,300	6,526,700	6,537,100	6,497,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.014%	▲ 0.009%	▲ 0.006%	▲ 0.010%
									コール市場残高	137,079	137,511	135,608	155,450	153,256
									うち無担	118,430	119,120	117,462	137,054	134,844
									うちO/N	55,827	55,397	52,999	71,391	67,911
									うち有担	18,649	18,391	18,146	18,396	18,412

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/13	2021/9/14	▲ 0.350	342	342		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/13	2021/9/14	▲ 0.350	226	226		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2021/9/15	2025/9/12	0	27,659

## ●2021年9月14日の予定

\*米国8月の消費者物価指数

\*流動性供給入札  
(5,000億円、9/15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