

Central Daily Market Report

2021年9月15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15日		2021年9月16日		2021年9月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 700		▲ 1,000	
財政	▲ 7,800		3,500		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 8,100		2,800		▲ 5,000	
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	2,900	▲ 2,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			13,400			
CP等買入	5,000	▲ 700		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	27,700	▲ 32,600				
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	200		400		
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	▲ 7,500		16,500		▲ 5,000	
当座預金残高	5,284,800		5,301,300		5,296,300	
準備預金残高	4,676,400					
積み終了先	4,676,400					
超過準備	4,676,400					
非準備預金先	608,400					
9月16日以降の残り所要積立額						
積数					3,615,500	
1日平均					120,500	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,615,500	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2021年9月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日の取引となったものの、レート水準は前日比で低下した。立ち上がりは国内勢を中心に▲0.05~▲0.01%の調達となり、一巡後も同水準の出合いが見られ、本積み期の取引を終えた。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、▲0.10~▲0.09%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>

本日のアウトライト市場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市場は複数件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

2021/9/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.069	0.030	▲ 0.010	30,511.71	▲ 158.39	109.71-72	109.43-45
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.098						
3W	▲ 0.010	0.150	0.054				-	▲ 0.102						
1M	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.017				-	▲ 0.102						
3M			0.010				▲ 0.119	▲ 0.109						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.130						
日付		9/8	9/9	9/10	9/13	9/14								
日銀当預残	5,309,100	5,319,700	5,280,500	5,282,000	5,292,300									
準備預金残	4,673,800	4,671,000	4,690,600	4,677,400	4,689,800									
マネタリーベース	6,526,700	6,537,100	6,497,100	6,498,200	6,507,800									
無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.006%	▲ 0.010%	▲ 0.016%	▲ 0.024%									
コール市場残高	135,608	155,450	153,256	144,838	146,218									
うち無担	117,462	137,054	134,844	126,279	127,287									
うちO/N	52,999	71,391	67,911	59,246	60,379									
うち有担	18,146	18,396	18,412	18,559	18,931									

●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年超3年以下)	4,500	2021/9/16			8,886	4,507	0.000		0.001	80.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/9/16			10,155	4,505	▲ 0.004		▲ 0.002	1.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/9/16			8,696	4,257	▲ 0.005		▲ 0.004	70.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/15	2021/9/16	▲ 0.350	381	381		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/15	2021/9/16	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月16日の予定

*月例経済報告 *8月の貿易統計	*米国7月の企業在庫 *米国8月の小売売上高	*国庫短期証券(1023回)入札 (1年、35,000億円、9/21発行) *20年利付国債入札 (12,000億円、9/17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