

Central Daily Market Report

2021年9月16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16日		2021年9月17日		2021年9月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 300		1,000	
財政	6,000		▲ 700		80,000	
資金過不足	5,200		▲ 1,000		81,000	
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	13,400					
CP等買入		▲ 100		▲ 1,000		
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	400		100		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	18,800		▲ 3,200		81,000	
当座預金残高	5,303,600		5,300,400		5,381,400	
準備預金残高	4,653,100					
積み終了先	3,442,100					
超過準備	1,462,200					
非準備預金先	650,500					
			9月17日以降の残り所要積立額			
			積数	424,600		
			1日平均	14,600		
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	88.26%	日数	3.33%		

●2021年9月16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▲0.06～▲0.005%の調達で始まった。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、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、▲0.09～▲0.10%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＞

本日はTB1Y物(1023回)の入札が実施され、甘めの結果となった。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

2021/9/16	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.095	0.040	0.010	30,323.34	▲ 188.37	109.38-39	109.35-36
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.013				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.119	▲ 0.109						
6M							▲ 0.119	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.116	▲ 0.130						
									日付	9/9	9/10	9/13	9/14	9/15
									日銀当預残	5,319,700	5,280,500	5,282,000	5,292,300	5,284,800
									準備預金残	4,671,000	4,690,600	4,677,400	4,689,800	4,676,400
									マネタリーベース	6,537,100	6,497,100	6,498,200	6,507,800	6,500,500
									無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.010%	▲0.016%	▲0.024%	▲0.033%
									コール市場残高	155,450	153,256	144,838	146,218	138,600
									うち無担	137,054	134,844	126,279	127,287	121,829
									うちO/N	71,391	67,911	59,246	60,379	55,441
									うち有担	18,396	18,412	18,559	18,931	16,771

●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	1023	-	35,000	2021/9/21	2022/9/20	94,986.0	28,840.7	100.1100	▲0.1101%	0.8469%	100.1160	▲0.1161%	6,159.0
20年利付国債	177	0.400%	12,000	2021/9/17	2041/6/20	31,468.0	9,826.00	99.7000	0.4160%	64.0878%	99.7700	0.4120%	2,164.0

●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)		2021/9/16	2021/9/17	▲ 0.350	80	80		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/16	2021/9/17	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月17日の予定

- *4-6月期の資金循環統計速報
- *7月の石油等消費動態統計
- *米国9月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *ユーロ圏8月の消費者物価指数改定値
- *国庫短期証券(1024回)入札(3ヶ月、50,000億円、9/21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