Central Daily Market Report

2021年9月17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17日 需給速報		2021年9月21日 需給予想		2021年9月22日 当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 500		0	
財政	▲ 3,400		75,000		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 3,800		74,500		▲ 4,000	
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						
CP等買入		▲ 1,000		▲ 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						▲ 186,700
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 6,300		74,400		▲ 190,700	

当座預金残高	5,297,300	5,371,700	5,181,000
準備預金残高	4,649,500		
積み終了先	4,649,200		
超過準備	4,556,300		
非準備預金先	647,800		

9月21日以降の残り所要積立額	
積数	6,000
1日平均	200

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	99.83%	日数 16.67%

●2021年9月17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～▲0.002%の調達で始まった。一巡後も朝方と同水準の出合いで推移し、レート水準は前日比で上昇した。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～▲0.085%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TB3M物(1024回)の入札が実施され、前回入札時からレートが上昇したものの、おおむね事前予想通りの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であった。

●短期金融市場関連指標

2021/9/17	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.022				－	▲ 0.097
T/N			▲ 0.025				－	▲ 0.094
S/N							－	－
1W	▲ 0.019	▲ 0.001	▲ 0.009				－	▲ 0.095
2W	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.016				－	▲ 0.100
3W							－	▲ 0.101
1M	▲ 0.010	0.000	▲ 0.005				－	▲ 0.102
3M							▲ 0.115	▲ 0.109
6M							▲ 0.119	▲ 0.120
1Y							▲ 0.116	▲ 0.130

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.045	0.005	30,500.05	176.71	109.69-71	109.94-95

日付	9/10	9/13	9/14	9/15	9/16
日銀当預残	5,280,500	5,282,000	5,292,300	5,284,800	5,303,600
準備預金残	4,690,600	4,677,400	4,689,800	4,676,400	4,653,100
マネタリーベース	6,497,100	6,498,200	6,507,800	6,500,500	6,520,100
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.016%	▲0.024%	▲0.033%	▲0.026%
コール市場残高	153,256	144,838	146,218	138,600	164,201
うち無担	134,844	126,279	127,287	121,829	146,593
うちO/N	67,911	59,246	60,379	55,441	75,820
うち有担	18,412	18,559	18,931	16,771	17,608

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1024	－	50,000	2021/9/21	2021/12/20	189,162.0	40,618.5	100.0270	▲0.1094%	86.6212%	100.0280	▲0.1135%	9,381.0

●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）		2021/9/17	2021/9/21	▲ 0.350	252	252		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/9/17	2021/9/21	▲ 0.350	9	9		▲0.350	▲0.350	
社債等買入（残存期間3年超5年以下）	750	2021/9/24			2,630	750	0.099		0.106	55.6

●2021年9月21日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合（1日目、22日まで）
*米国FOMC（1日目）
*米国8月の住宅着工件数
*国庫短期証券（1025回）入札
（6ヶ月、34,000億円、927/発行）
*流動性供給入札
（4,000億円、9/22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。
◆本資料は何ら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論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