

Central Daily Market Report

2021年9月21日(火)

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21日 需給速報	2021年9月22日 需給予想	2021年9月24日 当社予想			
銀行券	▲ 600	▲ 700	▲ 1,000			
財政	67,500	▲ 2,200	▲ 2,000			
資金過不足	66,900	▲ 2,900	▲ 3,000			
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		▲ 400	▲ 300			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						800
新型コロナ対応金融支援特別			241,800	▲ 186,700		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	66,600	52,100	▲ 2,200			
当座預金残高	5,363,900	5,416,000	5,413,800			
準備預金残高	4,711,900					
積み終了先	4,711,600			9月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,711,600			積数	5,700	
非準備預金先	652,000			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	99.84%	日数	20.00%		

●2021年9月21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▲0.060~▲0.003%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引合いが散見される程度であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲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TB6M物(1025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ドリーマーケットでは底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/9/21	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	
	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)	為替(17時)
単位:%									0.035	▲ 0.010	29,839.71	▲ 660.34	109.43-45	109.63-65
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.094						
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.003	0.001	0.000				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.018	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.115	▲ 0.108						
6M							▲ 0.115	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.116	▲ 0.130						
日付									9/13	9/14	9/15	9/16	9/17	
日銀当預残	5,282,000	5,292,300	5,284,800	5,303,600	5,297,300				5,282,000	5,292,300	5,284,800	5,303,600	5,297,300	
準備預金残	4,677,400	4,689,800	4,676,400	4,653,100	4,649,500				4,677,400	4,689,800	4,676,400	4,653,100	4,649,500	
マネタリーベース	6,498,200	6,507,800	6,500,500	6,520,100	6,514,100				6,498,200	6,507,800	6,500,500	6,520,100	6,514,100	
無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.024%	▲ 0.033%	▲ 0.026%	▲ 0.022%				▲ 0.016%	▲ 0.024%	▲ 0.033%	▲ 0.026%	▲ 0.022%	
コール市場残高	144,838	146,218	138,600	164,201	173,402				144,838	146,218	138,600	164,201	173,402	
うち無担	126,279	127,287	121,829	146,593	155,934				126,279	127,287	121,829	146,593	155,934	
うちO/N	59,246	60,379	55,441	75,820	77,831				59,246	60,379	55,441	75,820	77,831	
うち有担	18,559	18,931	16,771	17,608	17,468				18,559	18,931	16,771	17,608	17,468	

●入札結果

名称	回数	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	1025	-	34,000	2021/9/27	2022/3/25	136,935.0	27,635.5	100.0540	▲ 0.1100%	73.8648%	100.0560	▲ 0.1141%	6,364.0
流動性供給	342	-	4,000	2021/9/22		16,208.0	3,988.00		▲ 0.0050%	3.7158%		▲ 0.0070%	

●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)		2021/9/21	2021/9/22	▲ 0.350	156	156		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/21	2021/9/22	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/9/24	2021/9/30	0.330	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/9/22時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/9/22	2022/3/28	0	241,811	780,146

●2021年9月22日の予定

※日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)
※黒田日銀総裁、定例会見

※米国FOMC(2日目)
※米国FRB経済見通し発表
※米国8月の中古住宅販売

◆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