

# Central Daily Market Report

2021年9月24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24日 需給速報	2021年9月27日 需給予想	2021年9月28日 当社予想
銀行券	▲ 200	600	0
財政	2,900	▲ 7,300	▲ 1,000
資金過不足	2,700	▲ 6,700	▲ 1,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
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		13,900	
CP等買入		▲ 300	▲ 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	800	▲ 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	▲ 500	100	500
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	2,700	7,300	▲ 1,000
当座預金残高	5,419,200	5,426,500	5,425,500
準備預金残高	4,775,200		
積み終了先	4,774,900		9月27日以降の残り所要積立額
超過準備	4,774,900		積数 4,300
非準備預金先	644,000		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	99.88%	日数 36.67%

## ●2021年9月24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~▲0.002%の調達で始まった。一巡後も同水準の出会いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いがあった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.085%程度での出会い。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(1026回)の入札が実施され、年末越え銘柄ということもあって、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2021/9/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.022					-	▲ 0.092	0.050	0.020	30,248.81	609.41	110.32-33	110.47-47
T/N								-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W			0.001					-	▲ 0.099						
2W								-	▲ 0.099						
3W								-	▲ 0.101						
1M			▲ 0.010					-	▲ 0.101						
3M								▲ 0.144	▲ 0.108						
6M								▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.117	▲ 0.130						
										日付	9/15	9/16	9/17	9/21	9/22
										日銀当預残	5,284,800	5,303,600	5,297,300	5,363,900	5,416,500
										準備預金残	4,676,400	4,653,100	4,649,500	4,711,900	4,775,500
										マネタリーベース	6,500,500	6,520,100	6,514,100	6,581,500	6,634,700
										無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.026%	▲0.022%	▲0.022%	▲0.021%
										コール市場残高	138,600	164,201	173,402	172,697	178,857
										うち無担	121,829	146,593	155,934	155,594	161,437
										うちO/N	55,441	75,820	77,831	74,081	78,274
										うち有担	16,771	17,608	17,468	17,103	17,420

## ●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	1026	-	50,000	2021/9/27	2022/1/6	154,974.2	40,729.6	100.0360	▲0.1300%	47.7341%	100.0383	▲0.1383%	9,270.0

## ●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万円)	スタート日	エンド日	実行利率	応札総額(億円・百万円)	発札総額(億円・百万円)	抜付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均発札レート・利回較差・価格較差	抜付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/9/27			12,390	4,503	0.001		0.002	24.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/9/27			14,011	4,503	0.010		0.010	88.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/9/27			11,012	4,259	0.016		0.016	81.4
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/9/27			2,739	507	0.015		0.016	4.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/24	2021/9/27	▲ 0.350	429	429		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/24	2021/9/27	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年9月27日の予定

\*7月の景気動向指数改訂状況  
\*8月の企業向けサービス価格指数

\*米国8月の耐久財新規受注

◆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