

Central Daily Market Report

2021年9月27日(月)
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27日		2021年9月28日		2021年9月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		400		▲ 1,000	
財政	▲ 8,400		2,600		▲ 15,000	
資金過不足	▲ 7,900		3,000		▲ 16,000	
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
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		▲ 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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 200	500		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	5,900		3,200		▲ 18,900	
当座預金残高	5,425,100		5,428,300		5,409,400	
準備預金残高	4,778,600					
積み終了先	4,778,000		9月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,778,000		積数		3,700	
非準備預金先	646,500		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	99.90%	日数	40.00%		

●2021年9月27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～▲0.001%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き合いがあった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.095～▲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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。CP等買入オペは、事前予定通り5,000億円でオファーされた。

●短期金融市場関連指標

2021/9/27	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.097	0.050	0.000	30,240.06	▲ 8.75	110.76-77	110.77-78
T/N							-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.099						
2W							-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.099						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.144	▲ 0.109						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.130						
									日付	9/16	9/17	9/21	9/22	9/24
									日銀当預残	5,303,600	5,297,300	5,363,900	5,416,500	5,419,200
									準備預金残	4,653,100	4,649,500	4,711,900	4,775,500	4,774,700
									マネタリーベース	6,520,100	6,514,100	6,581,500	6,634,700	6,637,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.026%	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.021%	▲ 0.022%
									コール市場残高	164,201	173,402	172,697	178,857	182,934
									うち無担	146,593	155,934	155,594	161,437	165,371
									うちO/N	75,820	77,831	74,081	78,274	81,428
									うち有担	17,608	17,468	17,103	17,420	17,563

●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	業分率	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
CP等買入	5,000	2021/9/30			8,164	4,984	▲ 0.022		▲ 0.017	5.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/27	2021/9/28	▲ 0.350	222	222		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/27	2021/9/28	▲ 0.350	0	0				

●2021年9月28日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(7月15、16日分)	*米国7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(6,000億円、9/29発行)
	*米国9月のCB消費者信頼感指数	

◆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よう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