

Central Daily Market Report

2021年9月28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28日		2021年9月29日		2021年9月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400	▲ 300				800
財政	3,500	▲ 17,100				▲ 3,600
資金過不足	3,900	▲ 17,400				▲ 2,800
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			4,000	▲ 2,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入				▲ 800	5,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保提供						
当増減	4,100	▲ 16,100				2,200
当座預金残高	5,429,200		5,413,100			5,415,300
準備預金残高	4,797,500					
積み終了先	4,796,800				9月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,796,800				積数	3,000
非準備預金先	631,700				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	99.92%	日数	43.33%		

●2021年9月28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▲0.065~▲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、▲0.09~▲0.08%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>

本日は短国買入オベが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱めの結果となった。マーケット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。

●短期金融市場関連指標

2021/9/28	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.097	0.070	0.020	30,183.96	▲ 56.10	110.96-97	111.24-25	
T/N							-	▲ 0.095							
S/N			▲ 0.005				-	-							
1W							-	▲ 0.099							
2W							-	▲ 0.100							
3W							-	▲ 0.100							
1M	▲ 0.015	0.180	0.003				-	▲ 0.100							
3M			0.050					▲ 0.144							
6M								▲ 0.120							
1Y								▲ 0.117							
										日付	9/17	9/21	9/22	9/24	9/27
										日銀当預残	5,297,300	5,363,900	5,416,500	5,419,200	5,425,100
										準備預金残	4,649,500	4,711,900	4,775,500	4,774,700	4,778,100
										マネタリーベース	6,514,100	6,581,500	6,634,700	6,637,700	6,643,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.024%
										コーポ市場残高	173,402	172,697	178,857	182,934	183,493
										うち無担	155,934	155,594	161,437	165,371	166,222
										うちO/N	77,831	74,081	78,274	81,428	81,079
										うち有担	17,468	17,103	17,420	17,563	17,271

●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)
40年利付国債	14	0.70%	6,000	2021/9/29	2061/3/20	15,144.0	5,997.0	97.6200	0.7700%	40.9523%			

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/9/29	2021/10/13		3,951	3,951				
国庫短期証券買入	1,000	2021/9/29			8,847	1,003	0.005		0.006	10.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/28	2021/9/29	▲ 0.350	6	6		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/28	2021/9/29	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/9/30	2021/10/7	0.330	0	0				

●2021年9月29日の予定

*交付税特別会計借入
(11,000億円、10/8借入)

◆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