

Central Daily Market Report

2021年9月30日(木)
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30日		2021年10月1日		2021年10月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		100		1,000	
財政	▲ 8,500		▲ 21,400		▲ 39,000	
資金過不足	▲ 8,800		▲ 21,300		▲ 38,000	
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	9,500					
CP等買入	5,000	▲ 5,800				
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	▲ 1,300	100		1,300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 1,300		▲ 20,000		▲ 38,000	
当座預金残高	5,416,700		5,396,700		5,358,700	
準備預金残高	4,806,100					
積み終了先	4,806,100		10月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,804,400		積数		200	
非準備預金先	610,600		1日平均		0	
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	99.99%	日数	50.00%		

●2021年9月30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▲0.070~▲0.020%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、▲0.085~▲0.075%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。

●短期金融市場関連指標

2021/9/30	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.132	0.065	0.000	29,452.66	▲ 91.63	111.93-94	111.87-89
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.020	▲ 0.003	▲ 0.016				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.144	▲ 0.109						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.130						
									日付	9/22	9/24	9/27	9/28	9/29
									日銀当預残	5,416,500	5,419,200	5,425,100	5,429,200	5,418,000
									準備預金残	4,775,500	4,774,700	4,778,100	4,791,400	4,800,300
									マネタリーベース	6,634,700	6,637,700	6,643,100	6,646,800	6,636,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.024%	▲ 0.025%	▲ 0.025%
									コール市場残高	178,857	182,934	183,493	181,221	168,105
									うち無担	161,437	165,371	166,222	163,865	149,834
									うちO/N	78,274	81,428	81,079	75,962	62,111
									うち有担	17,420	17,563	17,271	17,356	18,271

●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)
2年利付国債	429	0.005%	30,000	2021/10/1	2023/10/1	105,694.0	24,903.00	100.2400	▲0.1140%	77.0964%	100.2420	▲0.1150%	5,091.0

●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)		2021/9/30	2021/10/1	▲ 0.350	1250	1250		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/30	2021/10/1	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年10月1日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI)+13 *決定会合における主な意見(9月21・22日分) *8月の完全失業率(市場予想:2.9%) *8月の有効求人倍率(市場予想:1.14倍) *9月の消費動向調査	*米国8月の個人所得・消費支出 *米国8月の建設支出 *米国9月のISM製造業景況指数 *ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値	*国庫短期証券(1027回)入札 (3ヶ月、50,000億円、10/4発行)
--	---	---

◆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