

# Central Daily Market Report

2021年9月14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14日 需給速報	2021年9月15日 需給予想	2021年9月16日 当社予想
銀行券	800	▲ 200	▲ 1,000
財政	9,000	▲ 5,700	2,000
資金過不足	9,800	▲ 5,900	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		2,900	▲ 2,400
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		5,000	▲ 700
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)		27,700	▲ 32,600
被災地支援			
社債等買入			▲ 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	▲ 200	700	200
米ドル資金供給用担保提供			
当増減	10,300	▲ 4,900	1,000
当座預金残高	5,292,300	5,287,400	5,288,400
準備預金残高	4,689,800		
積み終了先	4,689,800		9月15日以降の残り所要積立額
超過準備	4,689,800		積数
非準備預金先	602,500		1日平均
			0
			0
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			3,736,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			96.77%

## ●2021年9月14日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.06~▲0.005%の調達で始まった。一巡後は▲0.055~▲0.015%程度の出合いとなり、レート水準は前日比で低下した。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.07~▲0.055%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でオファーされ、弱めの結果となった。引き続き応札倍率が高く、売却需要の強さが意識される結果となった。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市場は複数件の入札が実施された。発行レートは引き続き期越え物で低位横ばい。

## ●短期金融市場関連指標

2021/9/14	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.063	0.040	0.000	30,670.10	222.73	109.99-00	110.00-01
T/N			▲ 0.008				-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.001				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.003	0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.119	▲ 0.109						
6M							▲ 0.120	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.130						
									日付	9/7	9/8	9/9	9/10	9/13
									日銀当預残	5,320,000	5,309,100	5,319,700	5,280,500	5,282,000
									準備預金残	4,670,000	4,673,800	4,671,000	4,690,600	4,677,400
									マネタリーベース	6,538,300	6,526,700	6,537,100	6,497,100	6,498,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.009%	▲ 0.006%	▲ 0.010%	▲ 0.016%
									コール市場残高	137,511	135,608	155,450	153,256	144,838
									うち無担	119,120	117,462	137,054	134,844	126,279
									うちO/N	55,397	52,999	71,391	67,911	59,246
									うち有担	18,391	18,146	18,396	18,412	18,559

## ●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)
流動性供給	341	-	5,000	2021/9/15		21,092.0	4,972.0		▲0.0010%	7.8033%		▲0.0020%	

## ●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	2021/9/15	2021/9/29		2,853	2,853				
国庫短期証券買入	1,000	2021/9/15			10,079	1,000	0.005		0.006	12.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/9/14	2021/9/15	▲ 0.350	189	189		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/9/14	2021/9/15	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/9/16	2021/9/24	0.330	1	1				

## ●2021年9月15日の予定

\*7月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.1%)  
\*7月の第3次産業活動指数

\*米国8月の鉱工業生産・設備稼働率  
\*英国8月の消費者物価指数

◆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