

Central Daily Market Report

2021年8月4日(水)

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8月4日 需給速報	2021年8月5日 需給予想	2021年8月6日 当社予想
銀行券	0	▲ 400	0
財政	▲ 79,900	2,000	2,000
資金過不足	▲ 79,900	1,600	2,000

●2021年8月4日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.06～▲0.025%の調達で始まった。一巡後は▲0.06%近辺での出合いが散見される程度で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散見された。

<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市場は、複数の業態から発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

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	▲ 4,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入			10,700			
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
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		100				
※ドル資金供給用担保準備供給						
当預増減	▲ 75,000		12,300			2,000

当座預金残高	5,281,200	5,293,500	5,295,500
準備預金残高	4,638,800		
積み終了先	4,638,800		8月5日以降の残り所要積立額
超過準備	4,638,800		積数
非準備預金先	642,400		1日平均
			0
積み期間(7/16～8/15)の所要準備額			3,747,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			64.52%

●短期金融市場関連指標

2021/8/4	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	▲ 0.039				-	▲ 0.082	0.000	▲ 0.005	27,584.08	▲ 57.75	108.98-00	109.10-12
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.093						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.113	▲ 0.103						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130						
									日付	7/28	7/29	7/30	8/2	8/3
									日銀当預残	5,360,300	5,372,300	5,388,800	5,373,300	5,356,200
									準備預金残	4,673,900	4,675,400	4,691,600	4,701,800	4,693,400
									マネタリーベース	6,579,700	6,592,500	6,608,800	6,592,500	6,575,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.043%	▲ 0.044%	▲ 0.043%	▲ 0.041%
									コール市場残高	158,443	156,558	159,181	155,959	146,969
									うち無担	137,520	137,024	138,396	136,620	127,250
									うちO/N	76,144	76,278	79,515	75,579	64,149
									うち有担	20,923	19,534	20,785	19,339	19,719

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非償格競争入札(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	応募総額(億円・百万ドル)	発注総額(億円・百万ドル)	授付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均発注レート・利回較差・価格較差	授付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/8/5			9,867	4,502	▲ 0.002		0.000	81.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/8/5			9,682	4,505	▲ 0.005		▲ 0.003	32.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2021/8/5			3,422	1,514	▲ 0.003		▲ 0.003	75.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/4	2021/8/5	▲ 0.350	37	37		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/4	2021/8/5	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月5日の予定

*英中銀MPC結果発表	*国庫短期証券(1013回)入札 (6ヶ月、34,000億円、8/10発行)	*10年物価連動国債 (2,000億円、8/6発行)
*米国6月の貿易収支		

◆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