

# Central Daily Market Report

2021年8月6日(金)

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6日		2021年8月10日		2021年8月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		200			0
財政	500		200			▲ 3,000
資金過不足	600		400			▲ 3,000
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						1,300
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			100		
<small>※ドル資金供給用担保確保供給</small>						
当預増減	200		200			▲ 1,700
当座預金残高	5,293,100		5,293,300		5,291,600	
準備預金残高	4,661,400					
積み終了先	4,661,400				8月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,661,400				積数	0
非準備預金先	631,700				1日平均	0
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						3,741,100
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	80.65%		

## ●2021年8月6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▲0.045~▲0.015%の調達で始まった。連休を挟む4日積みであることもあり、一部取り上がる先が見られた。一巡後は▲0.040~▲0.035%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、▲0.08~▲0.065%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TB3M物(1014回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。この他、6M物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は、大型の調達を含めて複数の業態から発行された。発行レートは、横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/8/6	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.065	0.001		▲ 0.028			-	▲ 0.077	0.010	0.005	27,820.04	91.92	109.75-76	109.71-73	
T/N				▲ 0.020			-	▲ 0.077							
S/N				▲ 0.015			-	-							
1W							-	▲ 0.081							
2W	▲ 0.040	▲ 0.003		▲ 0.037			-	▲ 0.086							
3W	▲ 0.033	▲ 0.030		▲ 0.032			-	▲ 0.091							
1M							-	▲ 0.097							
3M								▲ 0.111							
6M								▲ 0.125							
1Y								▲ 0.126							
										日付	7/30	8/2	8/3	8/4	8/5
										日銀当預残	5,388,800	5,373,300	5,356,200	5,281,200	5,292,900
										準備預金残	4,691,600	4,701,800	4,693,400	4,638,800	4,638,800
										マネタリーベース	6,608,800	6,592,500	6,575,400	6,500,300	6,512,500
										無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.043%	▲0.041%	▲0.039%	▲0.030%
										コール市場残高	159,181	155,959	146,969	142,809	146,499
										うち無担	138,396	136,620	127,250	122,497	126,188
										うちO/N	79,515	75,579	64,149	61,466	63,957
										うち有担	20,785	19,339	19,719	20,312	20,311

## ●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)
国庫短期証券	1014	-	50,000	2021/8/10	2021/11/8	197,438.5	40,613.0	100.0265	▲0.1074%	95.5839%	100.0273	▲0.1106%	9,386.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/8/20	2022/2/18	404,097.0	11,000.19		0.0000%	2.7222%		0.0000%	

## ●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)		2021/8/6	2021/8/10	▲ 0.350	102	102		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/6	2021/8/10	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年8月10日の予定

*6月の国際収支
*6月の特定サービス産業動態統計速報
*7月の景気ウオッチャー調査

◆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