

Central Daily Market Report

2021年8月10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8月10日		2021年8月11日		2021年8月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		100		0	
財政	▲ 3,800		▲ 1,100		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 3,600		▲ 1,000		▲ 9,000	
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				
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	▲ 400	100		400		
米ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 4,200		700		▲ 9,000	
当座預金残高	5,288,900		5,289,600		5,280,600	
準備預金残高	4,654,000					
積み終了先	4,654,000		8月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,654,000		積数		0	
非準備預金先	634,900		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	83.87%		

●2021年8月10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~▲0.015%での調達で始まった。積み最終週を迎え、着地に向けた調整でレート水準を切り上げる先が一部で見られた。一巡後は▲0.03%近辺の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GCT/Nは、▲0.075~▲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

2021/8/10	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)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.073	0.020	0.010	27,888.15	68.11	110.31-33	110.44-45
T/N							-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.023				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.039	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.084						
3W			0.001				-	▲ 0.090						
1M			0.000				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.109	▲ 0.103						
6M							▲ 0.126	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130						
									日付	8/2	8/3	8/4	8/5	8/6
									日銀当預残	5,373,300	5,356,200	5,281,200	5,292,900	5,293,100
									準備預金残	4,701,800	4,693,400	4,638,800	4,638,800	4,660,900
									マネタリーベース	6,592,500	6,575,400	6,500,300	6,512,500	6,512,600
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.041%	▲0.039%	▲0.030%	▲0.028%
									コール市場残高	155,959	146,969	142,809	146,499	157,215
									うち無担	136,620	127,250	122,497	126,188	137,060
									うちO/N	75,579	64,149	61,466	63,957	74,239
									うち有担	19,339	19,719	20,312	20,311	20,155

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(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)		2021/8/10	2021/8/11	▲ 0.350	430	430		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/10	2021/8/11	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/8/12	2021/8/19	0.350	0	0				

●2021年8月11日の予定

*7月のマネーストック	*米国7月の財政収支 *米国7月の消費者物価指数	*30年利付国債入札 (9,000億円、8/12発行) *エネルギー対策借入 (6,500億円、8/20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