

Central Daily Market Report

2021年8月11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11日		2021年8月12日		2021年8月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 500		0	
財政	▲ 2,500		▲ 8,500		74,000	
資金過不足	▲ 2,300		▲ 9,000		74,000	
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			7,500			
国債買入						
CP等買入				▲ 200		
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				
※ドル資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 600		▲ 1,700		74,000	
当座預金残高	5,288,300		5,286,600		5,360,600	
準備預金残高	4,651,500					
積み終了先	4,651,500		8月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,651,500		積数		0	
非準備預金先	636,800		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	87.10%		

●2021年8月11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▲0.05~▲0.015%での調達で始まった。引き続き着地に向けた調整による調達ニーズは強く、一巡後も朝方と同水準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>

本日は短国買入オベがオファーされ、無難な結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、3M物と6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、案件少なく閑散であった。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

2021/8/11	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.070	0.035	0.015	28,070.51	182.36	110.59-60	110.74-76
T/N							-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.040	▲ 0.003	▲ 0.033				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.110	▲ 0.103						
6M							▲ 0.126	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130						
									日付	8/3	8/4	8/5	8/6	8/10
									日銀当預残	5,356,200	5,281,200	5,292,900	5,293,100	5,288,900
									準備預金残	4,693,400	4,638,800	4,638,800	4,660,900	4,653,800
									マネタリーベース	6,575,400	6,500,300	6,512,500	6,512,600	6,508,200
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.039%	▲0.030%	▲0.028%	▲0.028%
									コール市場残高	146,969	142,809	146,499	157,215	136,074
									うち無担	127,250	122,497	126,188	137,060	116,076
									うちO/N	64,149	61,466	63,957	74,239	55,175
									うち有担	19,719	20,312	20,311	20,155	19,998

●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)
30年利付国債	71	0.70%	9,000	2021/8/12	2051/6/20	22,544.0	7,340.0	101.2000	0.6510%	35.9782%	101.3100	0.6470%	1,649.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2021/8/20	2022/8/22	192,446.0	6,499.92		0.0000%	3.3778%		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
国庫短期証券買入	7,500	2021/8/12			22,432	7,504	0.002		0.003	83.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/11	2021/8/12	▲ 0.350	27	27		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/11	2021/8/12	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月12日の予定

*7月の企業物価指数

*米国7月の生産者物価指数

*英国4-6月期のGDP速報値

◆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