

Central Daily Market Report

2021年8月12日(木)
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12日		2021年8月13日		2021年8月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		0		1,000	
財政	▲ 8,100		73,900		3,000	
資金過不足	▲ 8,600		73,900		4,000	
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			14,000			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
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		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 1,400		87,900		4,000	
当座預金残高	5,286,900		5,374,800		5,378,800	
準備預金残高	4,664,000					
積み終了先	4,664,000				8月13日以降の残所積立額	
超過準備	4,663,900				積数	0
非準備預金先	622,900				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	90.32%		

●2021年8月12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▲0.04~▲0.01%の調達で始まった。積みの着地に向けた調達ニーズは根強く、レートは前日比で上昇した。一巡後も同水準の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.07%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、大型案件を含め複数の発行が見られた。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

2021/8/12	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.069	0.020	▲ 0.015	28,015.02	▲ 55.49	110.37-39	110.37-39
T/N							-	▲ 0.075						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.038	0.045	▲ 0.030				-	▲ 0.080						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.085						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.009	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.110	▲ 0.104						
6M							▲ 0.126	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130						
									日付	8/4	8/5	8/6	8/10	8/11
									日銀当預残	5,281,200	5,292,900	5,293,100	5,288,900	5,288,300
									準備預金残	4,638,800	4,638,800	4,660,900	4,653,800	4,651,500
									マネタリーベース	6,500,300	6,512,500	6,512,600	6,508,200	6,507,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.030%	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.026%
									コール市場残高	142,809	146,499	157,215	136,074	135,819
									うち無担	122,497	126,188	137,060	116,076	116,289
									うちO/N	61,466	63,957	74,239	55,175	56,748
									うち有担	20,312	20,311	20,155	19,998	19,530

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/8/13			12,259	4,505	▲0.002		▲0.001	77.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/8/13			13,419	4,511	▲0.004		▲0.004	92.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/8/13			9,492	4,262	▲0.008		▲0.008	85.2
国債買入(物価連動債)	600	2021/8/13			1,820	602	▲0.050		▲0.113	14.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/12	2021/8/13	▲ 0.350	75	75		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/12	2021/8/13	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月13日の予定

*米国8月のミシガン大消費者信頼感指数速報

*国庫短期証券(1015回)入札(3ヶ月、50,000億円、8/16発行)
*流動性供給入札(5,000億円、8/16発行)
*国有林野借入(960億円、8/25借入)

◆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