

# Central Daily Market Report

2021年8月16日(月)  
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16日 需給速報	2021年8月17日 需給予想	2021年8月18日 当社予想
銀行券	600	500	0
財政	3,100	1,700	1,000
資金過不足	3,700	2,200	1,000
<b>金融調節</b>	<b>スタート</b>	<b>エンド</b>	<b>スタート</b>
貸出			
全店共通			
国債買現			▲ 4,000
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	▲ 200		5,000
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	▲ 300	200	300
※ドル資金供給用担保提供枠			
当預増減	3,400	2,400	2,000
当座預金残高	5,377,800	5,380,200	5,382,200
準備預金残高	4,678,400		
積み終了先	3,282,100		8月17日以降の残り所要積立額
超過準備	1,427,800		積数
非準備預金先	699,400		1日平均
			488,700
			16,300
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			3,739,200
準備預金進捗率	実績	86.93%	日数
			3.23%

## ●2021年8月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.065~▲0.025%での調達で始まった。新積み期を迎え、取り手の様子見姿勢からレートは低下した。一巡後は▲0.06~▲0.045%近辺で調整の出合いが見ら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で引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.115~▲0.095%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、6M物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態でまとまった発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/8/16	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.097	0.010	▲ 0.010	27,523.19	▲ 453.96	109.62-63	109.40-42
T/N							-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.055	▲ 0.008	▲ 0.039				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.102						
1M	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.150	▲ 0.108						
6M							▲ 0.131	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130						
									日付	8/6	8/10	8/11	8/12	8/13
									日銀当預残	5,293,100	5,288,900	5,288,300	5,286,900	5,374,400
									準備預金残	4,660,900	4,653,800	4,651,500	4,664,000	4,714,700
									マネタリーベース	6,512,600	6,508,200	6,507,500	6,506,500	6,594,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.026%	▲ 0.020%	▲ 0.017%
									コール市場残高	157,215	136,074	135,819	139,513	145,515
									うち無担	137,060	116,076	116,289	120,263	125,318
									うちO/N	74,239	55,175	56,748	61,872	68,027
									うち有担	20,155	19,998	19,530	19,250	20,197

## ●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)		2021/8/16	2021/8/17	▲ 0.350	262	262		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/16	2021/8/17	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年8月17日の予定

*6月の第3次産業活動指数	*米国6月の企業在庫
	*米国7月の小売売上高
	*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率
	*ユーロ圏4-6月期のGDP2次速報

◆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お客様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