Central Daily Market Report

2021年8月17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17日 需給速報		2021年8月18日 需給予想		2021年8月19日 当社予想	
銀行券	500		200		0	
財政	1,600		▲ 3,500		▲ 1,000	
資金過不足	2,100		▲ 3,300		▲ 1,000	
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			3,400	▲ 4,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入			5,000	▲ 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		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	2,200		2,100		▲ 1,000	

当座預金残高	5,380,000	5,382,100	5,381,100
準備預金残高	4,677,200		
積み終了先	4,640,000		
超過準備	4,224,100		
非準備預金先	702,800		

8月18日以降の残り所要積立額	
積数	22,000
1日平均	800

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	99.41%	日数 6.45%

●2021年8月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.065～▲0.025%が出合いの中心レートとなった。邦銀を中心とした調達で、積み期序盤という事もあり、取り急ぐ動きは見られなかった。一巡後は▲0.065～▲0.03%前後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、ロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.135～▲0.115%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>

本日は短国買入オペが1,000億円でオファーされた。前回からオファー額が減額となる中、無難な結果となった。マーケット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発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2021/8/17	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				－	▲ 0.124
T/N			▲ 0.028				－	▲ 0.120
S/N			▲ 0.015				－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.024				－	▲ 0.109
2W	▲ 0.040	0.150	▲ 0.019				－	▲ 0.108
3W			0.000				－	▲ 0.109
1M	▲ 0.038	0.001	▲ 0.023				－	▲ 0.109
3M							▲ 0.150	▲ 0.112
6M							▲ 0.130	▲ 0.120
1Y							▲ 0.126	▲ 0.130

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.005	▲ 0.005	27,424.47	▲ 98.72	109.29-30	109.32-33

日付	8/10	8/11	8/12	8/13	8/16
日銀当預残	5,288,900	5,288,300	5,286,900	5,374,400	5,377,800
準備預金残	4,653,800	4,651,500	4,664,000	4,714,700	4,678,400
マネタリーベース	6,508,200	6,507,500	6,506,500	6,594,000	6,596,900
無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.026%	▲0.020%	▲0.017%	▲0.036%
コール市場残高	136,074	135,819	139,513	145,515	155,115
うち無担	116,076	116,289	120,263	125,318	137,512
うちO/N	55,175	56,748	61,872	68,027	78,149
うち有担	19,998	19,530	19,250	20,197	17,603

●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Ｉ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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2021/8/18	2021/9/1		3,352	3,352				
国庫短期証券買入	1,000	2021/8/18			3,314	1,000	▲0.004		0.000	48.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/8/17	2021/8/18	▲ 0.350	86	86		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/8/17	2021/8/18	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/8/19	2021/8/26	0.340	1	1				

●2021年8月18日の予定

*6月の機械受注統計（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲2.8%）
*7月の貿易統計
*米国7月の住宅着工件数
*英国7月の消費者物価指数
*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値

◆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。
◆本資料は何ら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論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