

# Central Daily Market Report

2021年8月19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19日		2021年8月20日		2021年8月23日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	▲ 100		200			0	
財政	2,400		▲ 22,900			10,000	
資金過不足	2,300		▲ 22,700			10,000	
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		13,400					
CP等買入			▲ 200		▲ 700		
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)							
被災地支援							
社債等買入							
新型コロナウイルス対応金融支援特別							
ETF買入							
国債補完供給		▲ 800			800		
*ドル資金供給用担保提供							
当預増減	14,700		▲ 22,600			10,000	
当座預金残高	5,397,500		5,374,900			5,384,900	
準備預金残高	4,677,800						
積み終了先	4,676,600				8月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,675,700				積数	5,600	
非準備預金先	719,700				1日平均	200	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額							
準備預金進捗率							
実績		99.85%		日数		12.90%	

## ●2021年8月19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▲0.065~▲0.025%での調達で始まった。ビッド状況に変化は見られず、引き続き横ばいの水準での取引となった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いで本日の取引を終了した。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.135~▲0.100%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TB1Y物(1016回)の入札が実施され、前回入札時からレートは低下したものの、おおむね事前予想通りの無難な結果となった。結果発表後のセカンドリーマーケットでは底堅く推移した。その他の銘柄では、3M物に出合いが見られた。

### ＜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

2021/8/19	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.038					-	▲ 0.126	0.010	0.000	27,281.17	▲ 304.74	109.84-85	109.77-79
T/N	▲ 0.045	▲ 0.030	▲ 0.039					-	▲ 0.126						
S/N			▲ 0.015					-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.030	▲ 0.036					-	▲ 0.117						
2W								-	▲ 0.114						
3W								-	▲ 0.113						
1M								-	▲ 0.113						
3M								▲ 0.120	▲ 0.117						
6M								▲ 0.132	▲ 0.121						
1Y								▲ 0.130	▲ 0.130						
									日付	8/12	8/13	8/16	8/17	8/18	
									日銀当預残	5,286,900	5,374,400	5,377,800	5,380,000	5,382,800	
									準備預金残	4,664,000	4,714,700	4,678,400	4,677,200	4,683,700	
									マネタリーベース	6,506,500	6,594,000	6,596,900	6,598,500	6,601,200	
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.017%	▲ 0.036%	▲ 0.037%	▲ 0.037%	
									コール市場残高	139,513	145,515	155,115	161,909	158,373	
									うち無担	120,263	125,318	137,512	144,756	142,261	
									うちO/N	61,872	68,027	78,149	82,193	78,058	
									うち有担	19,250	20,197	17,603	17,153	16,112	

## ●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)
国庫短期証券	1016	-	35,000	2021/8/20	2022/8/22	119,842.0	28,440.7	100.1280	▲0.1271%	86.2370%	100.1330	▲0.1320%	6,559.0
流動性供給	340	-	5,000	2021/8/20		10,788.0	4,988.0		0.0080%	78.8235%		0.0040%	

## ●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)		2021/8/19	2021/8/20	▲ 0.350	748	748		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/19	2021/8/20	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2021/8/24			2,700	751	0.090		0.100	51.9

## ●2021年8月20日の予定

*7月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.4%	*国庫短期証券(1017回)入札 (3ヶ月、50,000億円、8/23発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、8/31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