

Central Daily Market Report

2021年8月24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24日		2021年8月25日		2021年8月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 200		▲ 1,000	
財政	200		▲ 36,100		0	
資金過不足	100		▲ 36,300		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	800					
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 178,800
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
米ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	600		▲ 37,100		▲ 179,800	
当座預金残高	5,384,600		5,347,500		5,167,700	
準備預金残高	4,689,200					
積み終了先	4,688,800				8月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,688,800				積数	3,200
非準備預金先	695,400				1日平均	100
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	99.91%	日数	29.03%		

●2021年8月24日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、昨日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.06～▲0.02%近辺の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.07～▲0.04%のレンジの出合いで推移した。ターム物は1W～2W物で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.095～▲0.085%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TB6M物(1018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、概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ダリーマーケットでは底堅く推移した。この他に、1Y物に出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/8/24	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.095	0.015	0.000	27,732.10	237.86	109.68-69	109.76-78
T/N							-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.043	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.097						
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.106						
3M			0.050				▲ 0.124	▲ 0.114						
6M							▲ 0.130	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130						
									日付	8/17	8/18	8/19	8/20	8/23
									日銀当預残	5,380,000	5,382,800	5,397,500	5,374,100	5,384,000
									準備預金残	4,677,200	4,683,700	4,677,800	4,673,400	4,686,700
									マネタリーベース	6,598,500	6,601,200	6,616,000	6,592,500	6,602,400
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.037%	▲0.038%	▲0.038%	▲0.032%
									コール市場残高	161,909	158,373	160,242	163,097	171,854
									うち無担	144,756	142,261	143,688	142,704	155,296
									うちO/N	82,193	78,058	76,615	77,131	92,683
									うち有担	17,153	16,112	16,554	20,393	16,558

●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	1018	-	34,000	2021/8/25	2022/2/25	150,617.0	27,658.5	100.0630	▲0.1248%	51.5330%	100.0660	▲0.1308%	6,341.0
5年利付国債	148	0.005%	25,000	2021/8/25	2026/6/20	76,277.0	20,306.0	100.5900	▲0.1160%	3.0486%	100.6100	▲0.1200%	4,687.0
交付税特会	-	-	10,500	2021/9/2	2022/3/4	382,099.0	10,500.01		0.0000%	2.7480%		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	申込総額(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)		2021/8/24	2021/8/25	▲ 0.350	94	94		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/24	2021/8/25	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/8/26	2021/9/2	0.340	2	2				

●2021年8月25日の予定

*6月の景気動向指数改訂状況

*米国7月の耐久財新規受注

◆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