

# Central Daily Market Report

2021年8月26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26日		2021年8月27日		2021年8月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 500			0
財政	3,400		▲ 12,500			15,000
資金過不足	2,100		▲ 13,000		15,000	
<b>金融調節</b>	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			1,000			
国債買入	9,400					
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
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	195,800	▲ 178,800				
E T F買入						
国債補充供給	▲ 100			100		
<small>※ドル資金供給用担保提供額</small>						
<b>当預増減</b>	28,300		▲ 12,200		15,000	
当座預金残高	5,374,400		5,362,200		5,377,200	
準備預金残高	4,687,700					
積み終了先	4,687,400		8月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,687,400		積数		2,600	
非準備預金先	686,700		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	99.93%	日数	35.48%		

## ●2021年8月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、特段の変動要因は見当たらず、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▲0.065~▲0.02%近辺の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲0.04%のレンジの出会いで推移した。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、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。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>

本日は短国買入オベが前回と同額でオファーされ、弱めの結果となった。マーケットでは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。また、CP等買入オベが5,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.010%、按分レート▲0.015%と前回(平均▲0.011%・按分▲0.013%)比で平均レートはわずかに上昇し、按分レートはわずかに低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/8/26	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.089	0.015	▲ 0.002	27,742.29	17.49	109.98-99	110.16-17
T/N	▲ 0.045	▲ 0.028	▲ 0.034				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.010	▲ 0.033				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.028	▲ 0.025	▲ 0.025				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.124	▲ 0.113						
6M							▲ 0.131	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.130						
									日付	8/19	8/20	8/23	8/24	8/25
									日銀当預残	5,397,500	5,374,100	5,384,000	5,384,600	5,346,100
									準備預金残	4,677,800	4,673,400	4,686,700	4,689,200	4,652,200
									マネタリーベース	6,616,000	6,592,500	6,602,400	6,603,100	6,564,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.038%	▲ 0.032%	▲ 0.037%	▲ 0.037%
									コール市場残高	160,242	163,097	171,854	157,279	161,263
									うち無担	143,688	142,704	155,296	140,715	143,069
									うちO/N	76,615	77,131	92,683	77,492	77,466
									うち有担	16,554	20,393	16,558	16,564	18,194

## ●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)
20年利付国債	177	0.400%	12,000	2021/8/27	2041/6/20	35,615.0	9,749.00	99.8500	0.4080%	72.6958%	99.8900	0.4050%	2,242.0

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2021/8/27			9,273	1,001	0.003		0.003	48.0
CP等買入	5,000	2021/8/31			8,116	4,984	▲0.015		▲0.010	30.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/26	2021/8/27	▲ 0.350	118	118		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/26	2021/8/27	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年8月27日の予定

*8月の都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮) ▲0.2%	*米国7月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1019回)入札 (3ヶ月、50,000億円、8/30発行) *交付税特別会計借入 (10,500億円、9/7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