

Central Daily Market Report

2021年8月27日(金)
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27日		2021年8月30日		2021年8月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 200		▲ 800	
財政	▲ 13,000		18,800		100	
資金過不足	▲ 13,500		18,600		▲ 700	
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	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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		100				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	▲ 12,700		18,300		4,300	
当座預金残高	5,361,700		5,380,000		5,384,300	
準備預金残高	4,694,200					
積み終了先	4,693,800		8月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,693,800		積数	1,600		
非準備預金先	667,500		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	99.96%	日数	45.16%		

●2021年8月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因による取り上がりなども見られず、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▲0.06~▲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、▲0.085~▲0.080%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TB3M物(1019回)の入札が実施され、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。

<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

2021/8/27	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	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				-	▲ 0.087	0.020	0.005	27,641.14	▲ 101.15	110.04-05	110.10-11
T/N			▲ 0.045				-	▲ 0.084						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.030	0.150	▲ 0.011				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.120	▲ 0.113						
6M							▲ 0.131	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.130						
									日付	8/20	8/23	8/24	8/25	8/26
									日銀当預残	5,374,100	5,384,000	5,384,600	5,346,100	5,374,400
									準備預金残	4,673,400	4,686,700	4,689,200	4,652,200	4,687,700
									マネタリーベース	6,592,500	6,602,400	6,603,100	6,564,900	6,594,400
									無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.032%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.037%
									コール市場残高	163,097	171,854	157,279	161,263	162,144
									うち無担	142,704	155,296	140,715	143,069	144,391
									うちO/N	77,131	92,683	77,492	77,466	77,643
									うち有担	20,393	16,558	16,564	18,194	17,753

●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	1019	-	50,000	2021/8/30	2021/11/29	185,474.0	40,618.6	100.0290	▲0.1162%	92.6187%	100.0300	▲0.1202%	9,381.0
交付税特会	-	-	10,500	2021/9/7	2022/3/8	385,638.0	10,500.33		0.0000%	2.7229%		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	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)		2021/8/27	2021/8/30	▲ 0.350	18	18		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/27	2021/8/30	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第45回	2021/9/1		5,024	23
成長基盤強化	米ドル特別第37期	2021/9/3		2,034	19
成長基盤強化	米ドル特別第33期(借り換え)	2021/9/3		3,706	27
成長基盤強化	米ドル特別第29期(借り換え)	2021/9/3		563	10
成長基盤強化	米ドル特別第25期(借り換え)	2021/9/3		849	9

●2021年8月30日の予定

*7月の商業動態統計速報

◆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