

Central Daily Market Report

2021年8月30日(月)
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30日		2021年8月31日		2021年9月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		500		1,000	
財政	16,600		3,200		▲ 23,000	
資金過不足	16,300		3,700		▲ 22,000	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,500			
CP等買入		▲ 200	5,000	▲ 3,800		
貸出支援基金(成)					5,000	▲ 4,000
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 300			300		
※ドル資金供給用担保準備供給						
当増減	15,700		15,500		▲ 24,400	
当座預金残高	5,377,400		5,392,900		5,368,500	
準備預金残高	4,705,700					
積み終了先	4,705,300				8月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,705,300				積数	1,200
非準備預金先	671,700				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	99.97%	日数	48.39%		

●2021年8月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前営業日対比で横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは国内勢から▲0.065~▲0.02%の水準での調達が見られた。一巡後は閑散で、▲0.07%近辺の出会いが見られた程度であった。ターム物はショートターム物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.085%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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、月初発行にあたり、複数の業態から発行が見られ、発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/8/30	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	▲ 0.036				-	▲ 0.088	0.015	▲ 0.005	27,789.29	148.15	109.85-87	109.80-82
T/N							-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.040				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.030	0.120	▲ 0.016				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.120	▲ 0.111						
6M							▲ 0.132	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.130						
									日付	8/23	8/24	8/25	8/26	8/27
									日銀当預残	5,384,000	5,384,600	5,346,100	5,374,400	5,361,700
									準備預金残	4,686,700	4,689,200	4,652,200	4,687,700	4,694,200
									マネタリーベース	6,602,400	6,603,100	6,564,900	6,594,400	6,582,300
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.037%
									コール市場残高	171,854	157,279	161,263	162,144	165,574
									うち無担	155,296	140,715	143,069	144,391	147,395
									うちO/N	92,683	77,492	77,466	77,643	79,927
									うち有担	16,558	16,564	18,194	17,753	18,179

●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1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)	発札総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均発札レート・利回差・価格差	抜付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/8/31			3,011	1,503	0.005		0.014	34.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/8/31			11,065	4,510	▲0.007		▲0.006	58.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/8/31			12,471	4,261	▲0.006		▲0.005	56.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/30	2021/8/31	▲0.350	270	270		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/30	2021/8/31	▲0.350	0	0				

●2021年8月31日の予定

*7月の完全失業率(市場予想:2.9%)	*米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(30,000億円、9/1発行)
*7月の有効求人倍率(市場予想:1.12倍)	*米国8月のCB消費者信頼感指数	*交付税特別会計借入(10,450億円、9/10借入)
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 市場予想:前月比▲2.5%	*米国8月のシカゴPM景況感指数	
*7月の住宅着工統計	*ユーロ圏8月の消費者物価指数速報値	
*8月の消費動向調査		

◆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