

Central Daily Market Report

2021年8月31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31日 | | 2021年9月1日 | | 2021年9月2日 | |
|-----------------------|------------|---------|----------------|---------|-----------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 500 | | 200 | | 1,000 | |
| 財政 | 3,400 | | ▲ 32,000 | | ▲ 20,000 | |
| 資金過不足 | 3,900 | | ▲ 31,800 | | ▲ 19,000 | |
| 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 | | | 2,400 | ▲ 3,400 | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | 1,000 | | | |
| 国債買入 | 10,500 | | | | | |
| CP等買入 | 5,000 | ▲ 3,800 | | | | |
| 貸出支援基金(成) | | | 5,000 | ▲ 3,200 | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | ▲ 200 | | | | |
| 新型コロナ対応金融支援特別 | | | | | | |
| E T F買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | | 300 | | | | |
| ※ドル資金供給用担保提供供給 | | | | | | |
| 当増減 | 15,700 | | ▲ 30,000 | | ▲ 19,000 | |
| 当座預金残高 | 5,393,100 | | 5,363,100 | | 5,344,100 | |
| 準備預金残高 | 4,717,100 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,716,700 | | 9月1日以降の残り所要積立額 | | | |
| 超過準備 | 4,716,700 | | 積数 | 900 | | |
| 非準備預金先 | 676,000 | | 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 | 99.98% | 日数 | 51.61% | | |

●2021年8月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末要因により一部の先で調達を控える動きが見られたものの、概ね横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは国内勢より▲0.065~▲0.02%の出会い。一巡後は▲0.08~▲0.07%の出会いが見られた。ターム物は1~2W物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%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。マーケットは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、発行案件が見られず、非常に閑散とした地合いに終始した。

●短期金融市場関連指標

| 2021/8/31 | 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 | ▲ 0.080 | 0.001 | ▲ 0.036 | | | | - | ▲ 0.087 | 0.020 | 0.005 | 28,089.54 | 300.25 | 109.94-95 | 109.81-83 |
| T/N | ▲ 0.045 | ▲ 0.028 | ▲ 0.034 | | | | - | ▲ 0.086 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.045 | ▲ 0.007 | ▲ 0.020 | | | | - | ▲ 0.087 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.045 | ▲ 0.035 | ▲ 0.040 | | | | - | ▲ 0.088 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.093 | | | | | | |
| 1M | ▲ 0.040 | ▲ 0.025 | ▲ 0.033 | | | | - | ▲ 0.103 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.120 | ▲ 0.111 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.132 | ▲ 0.121 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.129 | ▲ 0.130 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 8/24 | 8/25 | 8/26 | 8/27 | 8/30 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 5,384,600 | 5,346,100 | 5,374,400 | 5,361,700 | 5,377,400 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 4,689,200 | 4,652,200 | 4,687,700 | 4,694,200 | 4,705,700 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 6,603,100 | 6,564,900 | 6,594,400 | 6,582,300 | 6,598,300 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.037% | ▲ 0.037% | ▲ 0.037% | ▲ 0.037% | ▲ 0.036% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 157,279 | 161,263 | 162,144 | 165,574 | 149,636 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 140,715 | 143,069 | 144,391 | 147,395 | 132,980 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 77,492 | 77,466 | 77,643 | 79,927 | 68,812 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 16,564 | 18,194 | 17,753 | 18,179 | 16,656 |

●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) |
|--------|-----|--------|--------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 2年利付国債 | 428 | 0.005% | 30,000 | 2021/9/1 | 2023/9/1 | 109,771.0 | 24,373.0 | 100.2650 | ▲0.1270% | 43.1236% | 100.2690 | ▲0.1290% | 5,617.0 |
| 交付税特会 | - | - | 10,450 | 2021/9/10 | 2022/3/11 | 382,158.0 | 10,450.25 | | 0.0000% | 2.7346% | | 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) | 発札総額(億円・百万ドル) | 貸付レート・利回較差・価格較差 | 全取レート・利回較差・価格較差 | 平均貸付レート・利回較差・価格較差 | 貸付比率 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|---------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞ | 20,000 | 2021/9/1 | 2021/9/15 | | 2,351 | 2,351 | | | | |
| 国庫短期証券買入 | 1,000 | 2021/9/1 | | | 11,676 | 1,000 | | 0.004 | 0.004 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2021/8/31 | 2021/9/1 | ▲ 0.350 | 20 | 20 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2021/8/31 | 2021/9/1 | ▲ 0.350 | 0 | 0 | | | | |
| 米ドル資金供給 | | 2021/9/2 | 2021/9/9 | 0.330 | 0 | 0 | | | | |

●2021年9月1日の予定

| | |
|--------------------------|------------------|
| *若田部日銀副総裁、広島県金融経済懇談会にて講演 | *米国7月の建設支出 |
| *4-6月期の法人企業統計調査季報 | *米国8月のISM製造業景況指数 |

◆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