Central Daily Market Report

2021年8月3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3日 需給速報		2021年8月4日 需給予想		2021年8月5日 当社予想	
銀行券	100		200		▲ 1,000	
財政	▲ 17,300		▲ 78,700		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 17,200		▲ 78,500		▲ 2,000	
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			4,000	▲ 4,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入				▲ 100		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 17,100		▲ 73,600		▲ 2,000	

当座預金残高	5,356,200	5,282,600	5,280,600
準備預金残高	4,693,400		
積み終了先	4,693,400		
超過準備	4,693,400		
非準備預金先	662,800		

8月4日以降の残り所要積立額	
積数	100
1日平均	0

積み期間（7/16～8/15）の所要準備額			3,747,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 61.29%

●2021年8月3日の市場動向

<インターバンク市場>
本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.06～▲0.025%の調達で始まった。一巡後は▲0.065～▲0.06%近辺での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>
GC T/Nは、▲0.085～▲0.075%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>
本日は短国買入オペが5,000億円でオファーされ、やや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市場は昨日に引き続き入札件数が少なく、閑散であった。発行レートは、横ばい圏ながらも銘柄による差異が大きい。

●短期金融市場関連指標

2021/8/3	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.041				－	▲ 0.083
T/N							－	▲ 0.085
S/N			▲ 0.015				－	－
1W	▲ 0.050	0.010	▲ 0.035				－	▲ 0.090
2W	▲ 0.040	▲ 0.028	▲ 0.039				－	▲ 0.091
3W							－	▲ 0.094
1M			▲ 0.030				－	▲ 0.098
3M							▲ 0.113	▲ 0.103
6M							▲ 0.129	▲ 0.115
1Y							▲ 0.130	▲ 0.129

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.005	▲ 0.010	27,641.83	▲ 139.19	109.27-28	109.21-23

日付	7/27	7/28	7/29	7/30	8/2
日銀当預残	5,358,300	5,360,300	5,372,300	5,388,800	5,373,300
準備預金残	4,666,900	4,673,900	4,675,400	4,691,600	4,701,800
マネタリーベース	6,578,000	6,579,700	6,592,500	6,608,800	6,592,500
無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.041%	▲0.043%	▲0.044%	▲0.043%
コール市場残高	160,294	158,443	156,558	159,181	155,959
うち無担	140,200	137,520	137,024	138,396	136,620
うちO/N	79,924	76,144	76,278	79,515	75,579
うち有担	20,094	20,923	19,534	20,785	19,339

●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Ｉ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	363	0.100%	26,000	2021/8/4	2031/6/20	69,970.0	20,991.0	100.8600	0.0120%	31.6719%	100.8900	0.0090%	4,986	12.65
交付税特会	－	－	11,000	2021/8/13	2022/2/10	415,244.0	11,000.11		0.0000%	2.6491%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2021/8/4	2021/8/18		3,951	3,951				
国庫短期証券買入	5,000	2021/8/4			20,704	5,005	0.003		0.004	48.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/8/3	2021/8/4	▲ 0.350	62	62		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/8/3	2021/8/4	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/8/5	2021/8/12	0.340	0	0				

●2021年8月4日の予定

*8月の日銀当座預金増減要因見込み
*米国7月のISM非製造業景況指数

◆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。
◆本資料は何ら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論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