

Central Daily Market Report

2021年8月13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13日 需給速報	2021年8月16日 需給予想	2021年8月17日 当社予想
銀行券	0	600	0
財政	73,700	7,600	▲1,000
資金過不足	73,700	8,200	▲1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	14,000		
CP等買入		▲100	▲200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補充供給	▲200	100	200
<small>※ドル資金供給用担保提供継続</small>			
当預増減	87,500	8,200	▲1,000
当座預金残高	5,374,400	5,382,600	5,381,600
準備預金残高	4,714,600		
積み終了先	4,714,600		
超過準備	4,714,600		
非準備預金先	659,800		
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	0.00%	日数
			0.00%

●2021年8月13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▲0.04～▲0.01%での調達で始まった。実質的な積み最終日を迎え、着地に向けた調整で取り上がる動きが一部で見られたため、レート水準は上昇した。一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、1～2W物のショートタームで引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.10～▲0.085%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(1015回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、ショートカバーの動きもあってか強含んで推移した。

＜CP市場＞

CP市場は、案件少なく閑散であった。発行レートは、横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オペが5,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.011%・按分レート▲0.013%と、前回(平均▲0.009%・按分▲0.013%)比で平均レートは低下し、按分レートは横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2021/8/13	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	▲0.017				-	▲0.075	0.020	0.000	27,977.15	▲37.87	110.40-42	110.29-30
T/N							-	▲0.089						
S/N			▲0.015				-	-						
1W	▲0.030	0.001	▲0.020				-	▲0.093						
2W	▲0.050	▲0.005	▲0.032				-	▲0.093						
3W							-	▲0.094						
1M			▲0.008				-	▲0.100						
3M			0.005				▲0.150	▲0.107						
6M							▲0.129	▲0.117						
1Y							▲0.126	▲0.130						
									日付	8/5	8/6	8/10	8/11	8/12
									日銀当預残	5,292,900	5,293,100	5,288,900	5,288,300	5,286,900
									準備預金残	4,638,800	4,660,900	4,653,800	4,651,500	4,664,000
									マネタリーベース	6,512,500	6,512,600	6,508,200	6,507,500	6,506,500
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.026%	▲0.020%
									コール市場残高	146,499	157,215	136,074	135,819	139,513
									うち無担	126,188	137,060	116,076	116,289	120,263
									うちO/N	63,957	74,239	55,175	56,748	61,872
									うち有担	20,311	20,155	19,998	19,530	19,250

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	1015	-	50,000	2021/8/16	2021/11/15	215,604.0	40,618.5	100.0280	▲0.1122%	60.3417%	100.0280	▲0.1122%	9,381.0
流動性供給	339	-	5,000	2021/8/16		15,462.0	4,982.0		▲0.0010%	42.2043%		▲0.0030%	
国有林野借入	-	-	960	2021/8/25	2026/8/25	6,261.0	960.00		0.0000%	16.6667%		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	申込総額(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
CP等買入	5,000	2021/8/18			8,025	4,975	▲0.013		▲0.011	66.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/13	2021/8/16	▲0.350	191	191		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/13	2021/8/16	▲0.350	0	0				

●2021年8月16日の予定

*4-6月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率+0.7%)

◆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