

Central Daily Market Report

2021年8月20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20日		2021年8月23日		2021年8月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		300		0	
財政	▲ 23,500		12,000		2,000	
資金過不足	▲ 23,500		12,300		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 700		▲ 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						800
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給		800				
※ドル資金供給用担保貸付供給						
当預増減	▲ 23,400		12,100		2,800	
当座預金残高	5,374,100		5,386,200		5,389,000	
準備預金残高	4,673,400					
積み終了先	4,672,900		8月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,672,800		積数		3,900	
非準備預金先	700,700		1日平均		200	
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	99.90%	日数	22.58%		

●2021年8月20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▲0.065～▲0.025%での調達で始まった。週末3日積みにあたるものの、前日比でレート水準はほぼ横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.04～▲0.03%で散發的な出会いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.100～▲0.090%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TB3M物(1017回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。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。この他、1Y物に出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/8/20	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.092	0.005	▲ 0.005	27,013.25	▲ 267.92	109.77-78	109.61-63
T/N							-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.027				-	▲ 0.098						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.103						
1M			▲ 0.017				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.124	▲ 0.114						
6M							▲ 0.130	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.130						
									日付	8/13	8/16	8/17	8/18	8/19
									日銀当預残	5,374,400	5,377,800	5,380,000	5,382,800	5,397,500
									準備預金残	4,714,700	4,678,400	4,677,200	4,683,700	4,677,800
									マネタリーベース	6,594,000	6,596,900	6,598,500	6,601,200	6,616,000
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.036%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.038%
									コール市場残高	145,515	155,115	161,909	158,373	160,242
									うち無担	125,318	137,512	144,756	142,261	143,688
									うちO/N	68,027	78,149	82,193	78,058	76,615
									うち有担	20,197	17,603	17,153	16,112	16,554

●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	1017	-	50,000	2021/8/23	2021/11/22	204,062.0	40,612.4	100.0290	▲0.1162%	49.4865%	100.0309	▲0.1239%	9,387.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/8/31	2022/2/28	399,606.0	11,000.05		0.0000%	2.7528%		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)		2021/8/20	2021/8/23	▲ 0.350	12	12		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/20	2021/8/23	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月23日の予定

*米国7月の中古住宅販売

◆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