Central Daily Market Report

2021年8月23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23日 需給速報		2021年8月24日 需給予想		2021年8月25日 当社予想	
銀行券	100		▲ 200		0	
財政	10,000		300		▲ 25,000	
資金過不足	10,100		100		▲ 25,000	
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		▲ 200		▲ 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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給						
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	9,900		700		▲ 25,000	

当座預金残高	5,384,000	5,384,700	5,359,700
準備預金残高	4,686,700		
積み終了先	4,686,400		
超過準備	4,686,400		
非準備預金先	697,300		

8月24日以降の残り所要積立額	
積数	3,600
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 25.81%

●2021年8月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態の調達姿勢にあまり変化が見られず、先週とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.065～▲0.02%近辺の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.07～▲0.04%のレンジの出合いで推移した。ターム物は1W～1M物で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.100～▲0.090%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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/8/23	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	▲ 0.032				－	▲ 0.094
T/N			▲ 0.028				－	▲ 0.095
S/N			▲ 0.015				－	－
1W	▲ 0.038	▲ 0.025	▲ 0.029				－	▲ 0.097
2W	▲ 0.040	▲ 0.003	▲ 0.037				－	▲ 0.099
3W							－	▲ 0.102
1M	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.105
3M							▲ 0.124	▲ 0.113
6M							▲ 0.129	▲ 0.121
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130

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）
0.015	0.010	27,494.24	480.99	109.83-85	109.90-91

日付	8/16	8/17	8/18	8/19	8/20
日銀当預残	5,377,800	5,380,000	5,382,800	5,397,500	5,374,100
準備預金残	4,678,400	4,677,200	4,683,700	4,677,800	4,673,400
マネタリーベース	6,596,900	6,598,500	6,601,200	6,616,000	6,592,500
無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.037%	▲0.037%	▲0.038%	▲0.038%
コール市場残高	155,115	161,909	158,373	160,242	163,097
うち無担	137,512	144,756	142,261	143,688	142,704
うちO/N	78,149	82,193	78,058	76,615	77,131
うち有担	17,603	17,153	16,112	16,554	20,393

●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Ｉ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）	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）		2021/8/23	2021/8/24	▲ 0.350	44	44		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/8/23	2021/8/24	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月24日の予定

*米国7月の新築一戸建て販売件数

*国庫短期証券（1018回）入札
（6ヶ月、34,000億円、8/25発行）
*5年利付国債入札
（25,000億円、8/25発行）
*交付税特別会計借入
（10,500億円、9/2借入）

◆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