

Central Daily Market Report

2021年8月25日(水)
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25日		2021年8月26日		2021年8月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 37,400		4,000		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 37,700		2,900		▲ 24,000	
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			9,400			
CP等買入		▲ 900		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別			195,800 ▲ 178,800			
E T F買入						
国債補完供給		100				
当増減	▲ 38,500		29,200		▲ 24,000	
当座預金残高	5,346,100		5,375,300		5,351,300	
準備預金残高	4,652,200					
積み終了先	4,651,900		8月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,651,900		積数		2,900	
非準備預金先	693,900		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	99.92%	日数	32.26%		

●2021年8月25日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、ビッドサイドの状況にほとんど変化が見られず、昨日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▲0.06~▲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~2W物で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物に出合いが見られた。

<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

2021/8/25	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.091	0.017	0.002	27,724.80	▲ 7.30	109.72-73	109.74-76
T/N							-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W							-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.040	▲ 0.023	▲ 0.037				-	▲ 0.097						
3W			▲ 0.028				-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.124	▲ 0.114						
6M							▲ 0.131	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130						
									日付	8/18	8/19	8/20	8/23	8/24
									日銀当預残	5,382,800	5,397,500	5,374,100	5,384,000	5,384,600
									準備預金残	4,683,700	4,677,800	4,673,400	4,686,700	4,689,200
									マネタリーベース	6,601,200	6,616,000	6,592,500	6,602,400	6,603,100
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.038%	▲0.038%	▲0.032%	▲0.037%
									コール市場残高	158,373	160,242	163,097	171,854	157,279
									うち無担	142,261	143,688	142,704	155,296	140,715
									うちO/N	78,058	76,615	77,131	92,683	77,492
									うち有担	16,112	16,554	20,393	16,558	16,564

●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1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)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均貸付レート・利回差・価格差	貸付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/8/26			14,492	4,503	0.002		0.003	14.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/8/26			11,328	4,258	0.001		0.002	28.2
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/8/26			1,438	504	▲0.001		0.000	87.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/8/25	2021/8/26	▲0.350	23	23		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/8/25	2021/8/26	▲0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/8/26時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/8/26	2022/2/28	0	195,841	725,021

●2021年8月26日の予定

*月例経済報告	*米国4-6月期のGDP改定値	*20年利付国債入札(12,000億円、8/27発行)
*7月の企業向けサービス価格指数		

◆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