

Central Daily Market Report

2021年7月1日(木)

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7月1日		2021年7月2日		2021年7月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 400		1,000	
財政	▲ 23,500		▲ 60,000		3,000	
資金過不足	▲ 24,400		▲ 60,400		4,000	
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				▲ 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				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	1,100		400		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 23,700		▲ 60,300		4,000	
当座預金残高	5,355,400		5,295,100		5,299,100	
準備預金残高	4,725,900					
積み終了先	4,725,500				7月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,725,500				積数	600
非準備預金先	629,500				1日平均	0
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,632,600
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	53.33%		

●2021年7月1日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、四半期末越えの調達を控えていた先からのビッドが復活し、昨日と比べて出合い水準が上昇した。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.045~▲0.015%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲0.015%近辺のレンジで出合いが見られた。ターム物は1W~1M物を中心に引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/N(7/2-7/5)は、▲0.080~▲0.070%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。個別銘柄では2Y410~425、5Y140~147、10Y345~363、20Y170~176、30Y59~70、40Y10~14等にビッドの出入りがあった。

＜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市場は、数先からの発行にとどまり、発行総額400億円弱となった。発行レートは、引き続き低位横ばいでの推移であった。

●短期金融市場関連指標

2021/7/1	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.082	0.050	▲ 0.005	28,707.04	▲ 84.49	111.13-14	111.27-28
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.021				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.084						
3W			0.050				-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.025	0.100	▲ 0.010				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.103	▲ 0.099						
6M							▲ 0.106	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/24	6/25	6/28	6/29	6/30
									日銀当預残	5,351,300	5,358,200	5,343,900	5,354,300	5,379,100
									準備預金残	4,685,200	4,710,600	4,686,600	4,704,300	4,709,400
									マネタリーベース	6,564,700	6,572,600	6,558,800	6,570,200	6,595,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.029%	▲ 0.030%	▲ 0.029%	▲ 0.050%
									コール市場残高	163,454	170,103	145,276	150,362	113,638
									うち無担	143,097	149,200	122,785	129,690	94,974
									うちO/N	82,206	87,764	61,779	70,094	66,688
									うち有担	20,357	20,903	22,491	20,672	18,664

●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非償額募入札(億円)	非償募入札(億円)
10年利付国債	363	0.10%	26,000	2021/7/2	2031/6/20	74,413.0	21,016.00	100.4000	0.0590%	86.3638%	100.4100	0.0580%	4,957.0	15.07

●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)		2021/7/1	2021/7/2	▲ 0.350	397	397		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/1	2021/7/2	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月2日の予定

*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支	*米国5月の貿易収支	*国庫短期証券(1005回)入札
*6月のマネタリーベース	*米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫	(3ヶ月、60,000億円、7/5発行)
	*米国6月の雇用統計	

◆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