

# Central Daily Market Report

2021年7月2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7月2日		2021年7月5日		2021年7月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		700		1,000	
財政	▲ 59,700		▲ 5,900		1,000	
資金過不足	▲ 60,000		▲ 5,200		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			10,700			
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			600			
国債補完供給		400				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 59,900		6,100		2,000	
当座預金残高	5,295,500		5,301,600		5,303,600	
準備預金残高	4,661,200					
積み終了先	4,661,200					
超過準備	4,661,000					
非準備預金先	634,300					
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	100.00%	日数	63.33%		

## ●2021年7月2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▲0.045~▲0.015%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。一巡後も朝方と同水準のレートでの出会いが数件見られ、今週の取引を終えた。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(7/5-7/6)は、▲0.080~▲0.065%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。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>

本日はTB3M物(1005回)の入札が実施され、WI取引において▲0.101~▲100%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.0998%、按分落札利回▲0.0962%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.100%での出会いが見られるなど、底堅く推移した。

### <CP市場>

CP市場は、償還は無かったものの、複数の大型発行により発行総額は2,000億円となった。発行レートは、マイナス圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/7/2	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.077	0.040	▲ 0.010	28,783.28	76.24	111.56-58	111.56-58
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.075						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.019				-	▲ 0.080						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.084						
3W			0.010				-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.100	▲ 0.100						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/25	6/28	6/29	6/30	7/1
									日銀当預残	5,358,200	5,343,900	5,354,300	5,379,100	5,355,400
									準備預金残	4,710,600	4,686,600	4,704,300	4,709,400	4,725,900
									マネタリーベース	6,572,600	6,558,800	6,570,200	6,595,400	6,572,500
									無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.030%	▲0.029%	▲0.050%	▲0.030%
									コール市場残高	170,103	145,276	150,362	113,638	133,435
									うち無担	149,200	122,785	129,690	94,974	114,452
									うちO/N	87,764	61,779	70,094	66,688	67,906
									うち有担	20,903	22,491	20,672	18,664	18,983

## ●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	1005	-	60,000	2021/7/5	2021/10/4	154,797.0	48,866.2	100.0240	▲0.0962%	3.8526%	100.0249	▲0.0998%	11,133.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/7/5			15,455	4,506	0.003		0.004	81.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/7/5			12,157	4,504	0.002		0.002	84.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2021/7/5			3,246	1,505	0.000		0.001	73.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/2	2021/7/5	▲0.350	2	2		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/2	2021/7/5	▲0.350	0	0				

## ●2021年7月5日の予定

\*7月の日銀当座預金増減要因見込み

\*New York祝日(Independence Day, observed)

◆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