

Central Daily Market Report

2021年7月5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7月5日		2021年7月6日		2021年7月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600	▲ 100				0
財政	▲ 10,800	9,600				▲ 9,000
資金過不足	▲ 10,200	9,500				▲ 9,000
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						▲ 3,800
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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入	600					
国債補充供給						
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	1,100		9,400			▲ 12,800
当座預金残高	5,296,600		5,306,000			5,293,200
準備預金残高	4,696,200					
積み終了先	4,696,100				7月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,696,100				積数	100
非準備預金先	600,400				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	100.00%	日数	66.67%		

●2021年7月5日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落したことでレートは低下した。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%のレンジの出合いで推移した。ターム物は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(7/6-7/7)は、▲0.075～▲0.065%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2Y410～426、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、3M物が▲0.102%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は卸売、機械業態において大型発行が実施された。償還総額200億円程度に対して、発行総額は1,700億円程度と発行超となった。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

2021/7/5	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	
	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	▲ 0.031				-	▲ 0.073	0.030	▲ 0.010	28,598.19	▲ 185.09	111.13-14	110.90-92
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.072						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.013	▲ 0.031				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.040	0.095	▲ 0.026				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.088						
1M							-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.102	▲ 0.100						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/28	6/29	6/30	7/1	7/2
									日銀当預残	5,343,900	5,354,300	5,379,100	5,355,400	5,295,500
									準備預金残	4,686,600	4,704,300	4,709,400	4,725,900	4,661,200
									マネタリーベース	6,558,800	6,570,200	6,595,400	6,572,500	6,513,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.030%	▲ 0.029%	▲ 0.050%	▲ 0.030%	▲ 0.027%
									コール市場残高	145,276	150,362	113,638	133,435	143,185
									うち無担	122,785	129,690	94,974	114,452	122,228
									うちO/N	61,779	70,094	66,688	67,906	70,317
									うち有担	22,491	20,672	18,664	18,983	20,957

●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	業分率	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)	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/5	2021/7/6	▲ 0.350	10	10		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/5	2021/7/6	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月6日の予定

*5月の全世帯家計調査
市場予想：消費支出、前年比+10.9%
*5月の毎月勤労統計調査速報

*米国6月のISM非製造業景況指数

*30年利付国債入札
(9,000億円、7/7発行)
*交付税特別会計借入
(11,000億円、7/16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