

# Central Daily Market Report

2021年7月6日(火)

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6日 需給速報	2021年7月7日 需給予想	2021年7月8日 当社予想
銀行券	0	300	0
財政	12,400	▲7,900	3,000
資金過不足	12,400	▲7,600	3,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			2,400 ▲3,800
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			15,000
国債買入			
CP等買入		▲100	▲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			
E T F 買入			100
国債補完供給	▲100		100
*ドル円両立供給用担保提供供給			
当増減	12,200	6,100	3,000
当座預金残高	5,308,800	5,314,900	5,317,900
準備預金残高	4,686,500		
積み終了先	4,686,500		7月7日以降の残り所要積立額
超過準備	4,686,500		積数 100
非準備預金先	622,300		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 70.00%

## ●2021年7月6日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、昨日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは国内勢から▲0.05～▲0.015%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.06～▲0.015%のレンジの出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(7/7-7/8)は、▲0.080～▲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＞

本日は短国買入オベが前回から2,500億円増額の1兆5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差、按分落札利回較差ともに+0.003%と、やや弱い結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、3M物が▲0.102%で出合った。

### ＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は発行・償還共に200億円程度であった。案件少く閑散としたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/7/6	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	▲0.032				-	▲0.076	0.040	0.010	28,643.21	45.02	110.91-92	110.77-78
T/N			▲0.001				-	▲0.075						
S/N			▲0.015				-	-						
1W	▲0.025	▲0.017	▲0.024				-	▲0.079						
2W	▲0.040	▲0.015	▲0.023				-	▲0.082						
3W							-	▲0.087						
1M	▲0.025	0.150	0.020				-	▲0.092						
3M							▲0.102	▲0.099						
6M							▲0.105	▲0.113						
1Y							▲0.117	▲0.129						
									日付	6/29	6/30	7/1	7/2	7/5
									日銀当預残	5,354,300	5,379,100	5,355,400	5,295,500	5,296,600
									準備預金残	4,704,300	4,709,400	4,725,900	4,661,200	4,695,900
									マネタリーベース	6,570,200	6,595,400	6,572,500	6,513,000	6,513,500
									無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.050%	▲0.030%	▲0.027%	▲0.031%
									コール市場残高	150,362	113,638	133,435	143,185	132,909
									うち無担	129,690	94,974	114,452	122,228	111,449
									うちO/N	70,094	66,688	67,906	70,317	58,208
									うち有担	20,672	18,664	18,983	20,957	21,460

## ●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	71	0.700%	9,000	2021/7/7	2051/6/20	26,431.0	7,278.0	100.4500	0.6810%	52.9631%	100.4800	0.6800%	1,711	
交付税特会	-	-	11,000	2021/7/16	2022/1/18	422,215.0	10,990.17		0.0000%	2.6030%		0.0000%		10.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/7/7	2021/7/21		2,351	2,351				
国庫短期証券買入	15,000	2021/7/7			41,059	15,006	0.003		0.003	88.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/6	2021/7/7	▲0.350	63	63		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/6	2021/7/7	▲0.350	0	0				

## ●2021年7月7日の予定

- \*5月の景気動向指数速報
- \*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引

◆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