

Central Daily Market Report

2021年7月7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7月7日 需給速報	2021年7月8日 需給予想	2021年7月9日 当社予想
銀行券	300	▲ 500	▲ 1,000
財政	▲ 5,600	3,900	▲ 24,000
資金過不足	▲ 5,300	3,400	▲ 25,000
金融調節			
	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		9,400	
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			
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入	100		
国債補充供給		100	
※ドル資金供給用担保準備供給			
当増減	8,400	12,800	▲ 25,000
当座預金残高	5,317,200	5,330,000	5,305,000
準備預金残高	4,704,900		
積み終了先	4,704,900		7月8日以降の残り所要積立額
超過準備	4,704,900		積数
非準備預金先	612,300		1日平均
			0
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額			3,627,900
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			73.33%

●2021年7月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日対比で横ばい圏での取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態などから▲0.05~▲0.015%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲0.02%のレンジの出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(7/8-7/9)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>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額150億円程度に対して、発行総額は1,250億円程度と発行超であった。鉄鋼・電気機器業態において大型発行が見られ、比較的活況な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。

<CP市場>

本日のアウトライ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。

●短期金融市場関連指標

2021/7/7	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	▲ 0.032				-	▲ 0.072	0.030	▲ 0.010	28,366.95	▲ 276.26	110.59-61	110.63-65
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.072						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.077						
2W			▲ 0.008				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.102	▲ 0.099						
6M							▲ 0.105	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/30	7/1	7/2	7/5	7/6
									日銀当預残	5,379,100	5,355,400	5,295,500	5,296,600	5,308,800
									準備預金残	4,709,400	4,725,900	4,661,200	4,695,900	4,686,500
									マネタリーベース	6,595,400	6,572,500	6,513,000	6,513,500	6,525,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.050%	▲ 0.030%	▲ 0.027%	▲ 0.031%	▲ 0.032%
									コール市場残高	113,638	133,435	143,185	132,909	132,010
									うち無担	94,974	114,452	122,228	111,449	112,062
									うちO/N	66,688	67,906	70,317	58,208	57,516
									うち有担	18,664	18,983	20,957	21,460	19,948

●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)	募入最低値	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	応募総額(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	2021/7/8			13,734	4,501	▲0.001		0.000	63.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/7/8			13,825	4,255	▲0.012		▲0.009	49.4
国債買入(変動利付債)	300	2021/7/8			780	300	▲1.000		▲1.056	62.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/7	2021/7/8	▲ 0.350	11	11		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/7	2021/7/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/7/9	2021/7/15	0.350	1	1				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/7/12			2,296	1,251	▲0.062		▲0.053	86.7

●2021年7月8日の予定

*5月の国際収支	*米国5月の消費者信用残高	*国庫短期証券(1006回)入札 (6ヶ月、34,000億円、7/12発行)
*6月の景気ウォッチャー調査		*5年利付国債入札 (25,000億円、7/9発行)

◆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