

Central Daily Market Report

2021年7月9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9日		2021年7月12日		2021年7月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		500		1,000	
財政	▲ 23,200		14,100		3,000	
資金過不足	▲ 22,900		14,600		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				▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			1,300			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給						
当預増減	▲ 22,900		15,500		4,000	
当座預金残高	5,307,600		5,323,100		5,327,100	
準備預金残高	4,680,900					
積み終了先	4,680,900		7月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,680,900		積数		0	
非準備預金先	626,700		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	86.67%		

●2021年7月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、今積み期最後の3日積みであったが取り上がる動きは見られず、レート水準は前日比で概ね横ばいとなった。立ち上がりは国内勢から▲0.05~▲0.014%の水準での調達が見られた。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(7/12-7/13)は、▲0.08~▲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2Y410~426、5Y140~148、10Y345~363、20Y170~176、30Y59~71、40Y10~14等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB3M物(1007回)の入札が実施され、WI取引において▲0.108~▲0.103%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1038%、按分落札利回▲0.1002%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~▲0.098%での出会いが見られるなど、底堅く推移した。この他に1Y物が▲0.117%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。発行市場は償還総額1,300億円程度に対して、発行総額は2,300億円程度と発行超であった。案件数は少なかったものの、建設・その他金融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。

●短期金融市場関連指標

2021/7/9	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	▲ 0.034				-	▲ 0.072	0.026	0.001	27,940.42	▲ 177.61	109.80-81	110.01-02
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.075						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.079						
2W							-	▲ 0.082						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.087						
1M			0.001				-	▲ 0.091						
3M			0.015				▲ 0.100	▲ 0.100						
6M							▲ 0.131	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.129						
									日付	7/2	7/5	7/6	7/7	7/8
									日銀当預残	5,295,500	5,296,600	5,308,800	5,317,200	5,330,500
									準備預金残	4,661,200	4,695,900	4,686,500	4,704,900	4,697,300
									マネタリーベース	6,513,000	6,513,500	6,525,700	6,533,800	6,547,700
									無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.031%	▲0.032%	▲0.032%	▲0.033%
									コール市場残高	143,185	132,909	132,010	133,796	134,815
									うち無担	122,228	111,449	112,062	113,134	115,285
									うちO/N	70,317	58,208	57,516	57,638	59,439
									うち有担	20,957	21,460	19,948	20,662	19,530

●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	1007	-	53,000	2021/7/12	2021/10/11	139,666.0	43,161.7	100.0250	▲0.1002%	99.8122%	100.0259	▲0.1038%	9,838.0
エネルギー対策	-	-	8,000	2021/7/20	2022/7/20	226,822.0	7,999.99		0.0000%	3.5270%		0.0000%	

●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)		2021/7/9	2021/7/12	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/9	2021/7/12	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月12日の予定

- *5月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+2.6%)
- *6月の企業物価指数

◆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