

Central Daily Market Report

2021年7月13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13日 需給速報	2021年7月14日 需給予想	2021年7月15日 当社予想
銀行券	400	100	▲ 1,000
財政	▲ 7,400	▲ 29,700	3,000
資金過不足	▲ 7,000	▲ 29,600	2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		12,500	
国債買入			
CP等買入		▲ 100	▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 100
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 100	200	100
米ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 7,000	▲ 17,300	2,000
当座預金残高	5,312,700	5,295,400	5,297,400
準備預金残高	4,670,800		
積み終了先	4,670,800	7月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,670,800	積数	0
非準備預金先	641,900	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
			93.33%

●2021年7月13日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.055～▲0.018%の調達で始まった。積み最終日を2営業日後に控えているが、着地に目処が立ちつつあることから、レート水準は前日比で若干低下した。一巡後は▲0.05%近辺の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(7/14-7/15)は、▲0.095～▲0.075%程度での出合い。SCはローラー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＞

本日は短国買入オペが前回から2,500億円減額の1兆2,500億円でおファーされ、平均落札利回り較差+0.002%、按分落札利回り較差+0.001%と無難な結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は、建設や電気・ガス業態から大型発行が実施されて発行総額1,600億円であったものの、償還額が2,300億円であったことから償還超であった。発行レートは、引き続き低位で推移した。CP等買入オペは、事前予定通り5,000億円でおファーされ、平均落札レート▲0.005%、按分レート▲0.012%と前回比で平均・按分ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2021/7/13	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	▲ 0.038				-	▲ 0.081	0.020	▲ 0.005	28,718.24	149.22	110.32-33	110.36-38
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.017	▲ 0.029				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.015				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.102	▲ 0.100						
6M							▲ 0.131	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.118	▲ 0.129						
									日付	7/6	7/7	7/8	7/9	7/12
									日銀当預残	5,308,800	5,317,200	5,330,500	5,307,600	5,319,700
									準備預金残	4,686,500	4,704,900	4,697,300	4,680,900	4,679,500
									マネタリーベース	6,525,700	6,533,800	6,547,700	6,524,400	6,536,200
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.032%	▲0.033%	▲0.034%	▲0.035%
									コール市場残高	132,010	133,796	134,815	140,848	134,809
									うち無担	112,062	113,134	115,285	120,664	114,262
									うちO/N	57,516	57,638	59,439	65,068	60,386
									うち有担	19,948	20,662	19,530	20,184	20,547

●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)	非償格競争入札(億円)
20年利付国債	177	0.400%	12,000	2021/7/14	2041/6/20	34,461.0	9,804.0	99,8500	0.4080%	9.4094%	99.9200	0.4040%	2,184	
交付税特会	-	-	11,000	2021/7/26	2022/1/26	412,415.0	10,990.11		0.0000%	2.6649%		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
国庫短期証券買入	12,500	2021/7/14			35,995	12,502	0.001		0.002	77.8
CP等買入	5,000	2021/7/16			6,748	4,990	▲0.012		▲0.005	55.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/13	2021/7/14	▲0.350	58	58		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/13	2021/7/14	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2021/7/15	2021/7/29	0.350	0	0				

●2021年7月14日の予定

*米国ページブック	*米国6月の生産者物価指数	*英国6月の消費者物価指数
-----------	---------------	---------------

◆本資料は信頼できるとさ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