

Central Daily Market Report

2021年7月14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14日 需給速報	2021年7月15日 需給予想	2021年7月16日 当社予想			
銀行券	100	▲ 900	▲ 1,000			
財政	▲ 29,700	2,300	2,000			
資金過不足	▲ 29,600	1,400	1,000			
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	12,500					
国債買入			13,900			
CP等買入		▲ 200	▲ 500	5,000		
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	▲ 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				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 17,300	14,700	6,000			
当座預金残高	5,295,400	5,310,100	5,316,100			
準備預金残高	4,656,300					
積み終了先	4,656,300			7月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,656,300			積数	0	
非準備預金先	639,100			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	96.67%		

●2021年7月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.06~▲0.025%での調達で始まった。積み最終日の前日にあたるものの、積みの着地に目途がついたことで調達を控える先が多く、前日比でレート水準は低下した。一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、1~2W物の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(7/15-7/16)は、▲0.10~▲0.085%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、5Y140~148、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>

本日のアウトラ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。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施されたため発行超となった。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

2021/7/14	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	▲ 0.043				-	▲ 0.093	0.015	▲ 0.005	28,608.49	▲ 109.75	110.58-60	110.50-51
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.009	▲ 0.016				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.093						
1M	▲ 0.008	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.096						
3M			0.013				▲ 0.102	▲ 0.100						
6M							▲ 0.131	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.118	▲ 0.129						
									日付	7/7	7/8	7/9	7/12	7/13
									日銀当預残	5,317,200	5,330,500	5,307,600	5,319,700	5,312,700
									準備預金残	4,704,900	4,697,300	4,680,900	4,679,500	4,670,800
									マネタリーベース	6,533,800	6,547,700	6,524,400	6,536,200	6,528,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.032%	▲ 0.033%	▲ 0.034%	▲ 0.035%	▲ 0.038%
									コール市場残高	133,796	134,815	140,848	134,809	137,140
									うち無担	113,134	115,285	120,664	114,262	117,915
									うちO/N	57,638	59,439	65,068	60,386	63,579
									うち有担	20,662	19,530	20,184	20,547	19,225

●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	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/7/15			12,770	4,506	▲0.004		▲0.002	7.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/7/15			12,133	4,503	▲0.005		▲0.004	24.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/7/15			7,758	4,252	▲0.003		0.000	70.0
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/7/15			1,604	505	▲0.002		▲0.001	34.0
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2021/7/14	2021/7/15	▲ 0.350	21	21		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先・即日(午後オファー分))		2021/7/14	2021/7/15	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月15日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合 (1日目、16日まで)	*米国6月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1008回)入札 (3ヶ月、53,000億円、7/19発行)
*5月の第3次産業活動指数		*流動性供給入札 (4,000億円、7/16発行)
		*交付税特別会計借入 (11,000億円、7/28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