

# Central Daily Market Report

2021年7月15日(木)  
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15日		2021年7月16日		2021年7月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 800			0
財政	▲ 600		800			9,000
資金過不足	▲ 1,500		0			9,000
<b>金融調節</b>	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	13,900					
CP等買入		▲ 500	5,000	▲ 500		
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	▲ 500			500		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	11,300		5,000			9,000
当座預金残高	5,306,700		5,311,700			5,320,700
準備預金残高	4,665,100					
積み終了先	4,665,100				7月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,665,100				積数	3,747,800
非準備預金先	641,600				1日平均	120,900
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額						3,747,800
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2021年7月15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▲0.055~▲0.025%での調達で始まった。積み最終日を迎え、着地に向けた調整で取り上がる動きが一部で見られたため、前日比でレート水準は上昇した。一巡後は▲0.04%近辺の出合いが数件見られ、今積み期の取引を終えた。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(7/16~7/19)は、▲0.09~▲0.075%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>

本日はTB3M物(1008回)の入札が実施され、堅調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは強含む展開となった。

### <CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2021/7/15	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.089	0.010	▲ 0.005	28,279.09	▲ 329.40	109.99-00	109.77-79
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.015	▲ 0.024				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.025	▲ 0.003	▲ 0.018				-	▲ 0.089						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.093						
1M	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.008				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.125	▲ 0.100						
6M							▲ 0.131	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.118	▲ 0.129						
									日付	7/8	7/9	7/12	7/13	7/14
									日銀当預残	5,330,500	5,307,600	5,319,700	5,312,700	5,295,400
									準備預金残	4,697,300	4,680,900	4,679,500	4,670,800	4,656,300
									マネタリーベース	6,547,700	6,524,400	6,536,200	6,528,800	6,511,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.034%	▲ 0.035%	▲ 0.038%	▲ 0.043%
									コール市場残高	134,815	140,848	134,809	137,140	141,196
									うち無担	115,285	120,664	114,262	117,915	121,737
									うちO/N	59,439	65,068	60,386	63,579	67,351
									うち有担	19,530	20,184	20,547	19,225	19,459

## ●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)
国庫短期証券	1008	-	53,000	2021/7/19	2021/10/18	210,681.5	43,156.8	100.0265	▲0.1062%	57.4459%	100.0267	▲0.1070%	9,843	
流動性供給	337	-	4,000	2021/7/16		19,292.0	3,993.0		▲0.0020%	26.2886%		▲0.0050%		
交付税特会	-	-	11,000	2021/7/28	2022/1/28	408,167.0	10,990.06		0.0000%	2.6926%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/15	2021/7/16	▲ 0.350	138	138		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/15	2021/7/16	▲ 0.350	363	363		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2021年7月16日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)  
\*黒田日銀総裁、定例会見  
\*経済・物価情勢の展望  
\*5月の石油等消費動態統計

\*米国6月の小売売上高  
\*米国5月の企業在庫  
\*米国7月のミンガン大消費者信頼感指数速報  
\*ユーロ圏6月の消費者物価指数改定値

◆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