

Central Daily Market Report

2021年7月20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20日		2021年7月21日		2021年7月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 1,300		1,000	
財政	▲ 8,400		5,900		6,000	
資金過不足	▲ 10,500		4,600		7,000	
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			4,000	▲ 2,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 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		▲ 500		▲ 500	800	
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	100		100		
※ドル資金供給用担保提供						
当増増減	▲ 11,500		5,600		7,800	
当座預金残高	5,305,600		5,311,200		5,319,000	
準備預金残高	4,615,100					
積み終了先	4,614,500			7月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,613,700			積数	4,800	
非準備預金先	690,500			1日平均	200	
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	99.87%	日数	16.13%		

●2021年7月20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▲0.060~▲0.020%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが散発的に続いて本日の取引を終了した。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は、▲0.10~▲0.09%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。

<短国市場>

本日はTB6M物(1010回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは底堅い推移となった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/7/20	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	▲ 0.035				-	▲ 0.095	0.010	▲ 0.004	27,388.16	▲ 264.58	109.52-53	109.62-63
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.015	▲ 0.024				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.033				-	▲ 0.097						
3W	▲ 0.007	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.097						
1M	▲ 0.028	0.050	▲ 0.002				-	▲ 0.100						
3M			0.180				▲ 0.125	▲ 0.105						
6M							▲ 0.125	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.129						
									日付	7/13	7/14	7/15	7/16	7/19
									日銀当預残	5,312,700	5,295,400	5,306,700	5,312,700	5,317,100
									準備預金残	4,670,800	4,656,300	4,665,100	4,644,400	4,659,100
									マネタリーベース	6,528,800	6,511,500	6,523,600	6,530,500	6,535,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.043%	▲ 0.037%	▲ 0.035%	▲ 0.035%
									コール市場残高	137,140	141,196	153,585	168,759	158,932
									うち無担	117,915	121,737	133,039	148,944	137,777
									うちO/N	63,579	67,351	81,453	96,263	82,066
									うち有担	19,225	19,459	20,546	19,815	21,155

●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	1010	-	34,000	2021/7/26	2022/1/25	120,384.0	27,689.5	100.0590	▲0.1176%	33.8376%	100.0610	▲0.1215%	6,310.0
流動性供給	338	-	5,000	2021/7/21		15,900.0	4,988.0		▲0.0110%	92.3159%		▲0.0120%	

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2021/7/21	2021/8/4		3,951	3,951				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/20	2021/7/21	▲ 0.350	91	91		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/20	2021/7/21	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月21日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(6月17、18日分)	*国庫短期証券(1011回)入札(3ヶ月、53,000億円、7/26発行)
*6月の貿易統計	*交付税特別会計借入(11,000億円、7/30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