

Central Daily Market Report

2021年7月26日(月)
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26日		2021年7月27日		2021年7月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,600		900		0	
財政	8,800		4,600		▲ 11,000	
資金過不足	10,400		5,500		▲ 11,000	
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	14,100					
CP等買入		▲ 200		▲ 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	800	▲ 100		▲ 300		
新型コロナ対応金融支援特別			132,200	▲ 118,200		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 600	200		600		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	24,600		19,300		▲ 11,000	
当座預金残高	5,339,800		5,359,100		5,348,100	
準備預金残高	4,652,300					
積み終了先	4,652,000		7月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,652,000		積数	2,300		
非準備預金先	687,500		1日平均	100		
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	99.94%	日数	35.48%		

●2021年7月26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~▲0.015%の調達で始まった。積み期前半であることもあり、調達スタンスに変化は見られず、前週から概ね横ばいの動きとなった。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲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。

<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、小口の案件が中心で償還超となり、閑散とした展開に終結した。

●短期金融市場関連指標

2021/7/26	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	▲ 0.038				-	▲ 0.090	0.010	0.000	27,833.29	285.29	110.54-56	110.20-22
T/N	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.090						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.040	0.015	▲ 0.020				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.094						
3W			0.000				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.108	▲ 0.104						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.129						
									日付	7/15	7/16	7/19	7/20	7/21
									日銀当預残	5,306,700	5,312,700	5,317,100	5,305,600	5,315,200
									準備預金残	4,665,100	4,644,400	4,659,100	4,615,100	4,631,800
									マネタリーベース	6,523,600	6,530,500	6,535,900	6,526,500	6,537,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.037%	▲ 0.035%	▲ 0.035%	▲ 0.035%	▲ 0.038%
									コール市場残高	153,585	168,759	158,932	162,047	174,254
									うち無担	133,039	148,944	137,777	143,658	154,517
									うちO/N	81,453	96,263	82,066	86,362	95,121
									うち有担	20,546	19,815	21,155	18,389	19,737

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/26	2021/7/27	▲ 0.350	522	522		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/26	2021/7/27	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/7/27時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/7/27	2022/1/31	0		132,212
					707,936

●2021年7月27日の予定

*6月の企業向けサービス価格指数	*米国FOMC(1日目)	*40年利付国債入札(6,000億円、7/28発行)
	*米国5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
	*米国6月の耐久財新規受注	
	*米国7月のCB消費者信頼感指数	

◆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