

# Central Daily Market Report

2021年7月27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27日		2021年7月28日		2021年7月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		300		0	
財政	4,000		▲ 8,100		4,000	
資金過不足	4,900		▲ 7,800		4,000	
<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			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 100		
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	▲ 200	600		200		
米ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	18,500		2,200		4,000	
当座預金残高	5,358,300		5,360,500		5,364,500	
準備預金残高	4,666,900					
積み終了先	4,666,600		7月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,666,600		積数	2,000		
非準備預金先	691,400		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	99.95%	日数	38.71%		

## ●2021年7月27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。調達先に若干の変化はあるものの、全体のレート目線には大きな変化は見られず、前日比で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>

本日は短国買入オベがオファーされ、やや弱い結果となった。マーケットは動意なく閑散中、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見られ、発行レートは横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オベが5,000億円オファーされ、按分落札レート▲0.013%、平均落札レート▲0.009%の結果となった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/7/27	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	▲ 0.039				-	▲ 0.089	0.015	0.005	27,970.22	136.93	110.30-32	110.08-10
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.014	0.010	0.002				-	▲ 0.093						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.025	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.108	▲ 0.105						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.129						
									日付	7/16	7/19	7/20	7/21	7/26
									日銀当預残	5,312,700	5,317,100	5,305,600	5,315,200	5,339,800
									準備預金残	4,644,400	4,659,100	4,615,100	4,631,800	4,652,100
									マネタリーベース	6,530,500	6,535,900	6,526,500	6,537,400	6,560,400
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.035%	▲0.035%	▲0.038%	▲0.038%
									コール市場残高	168,759	158,932	162,047	174,254	162,969
									うち無担	148,944	137,777	143,658	154,517	142,328
									うちO/N	96,263	82,066	86,362	95,121	82,472
									うち有担	19,815	21,155	18,389	19,737	20,641

## ●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)
40年利付国債	14	0.70%	6,000	2021/7/28	2061/3/20	16,276.0	5,993.0	98.8000	0.7350%	7.7654%			

## ●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	10,000	2021/7/28			34,123	10,005	0.003		0.004	72.9
CP等買入	5,000	2021/7/30			8,830	4,978	▲0.013		▲0.009	33.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/27	2021/7/28	▲ 0.350	168	168		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/27	2021/7/28	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/7/29	2021/8/5	0.340	0	0				

## ●2021年7月28日の予定

*決定会合における主な意見(7月15、16日分)	*米国FOMC(2日目)	*交付税特別会計借入(11,000億円、8/6借入)
*5月の景気動向指数改訂状況		

◆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