

Central Daily Market Report

2021年7月28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28日		2021年7月29日		2021年7月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 800		0	
財政	▲ 7,800		3,400		11,100	
資金過不足	▲ 7,500		2,600		11,100	
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	10,000					
国債買入			10,400			
CP等買入		▲ 100		▲ 100	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				
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	200		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	2,000		13,400		16,100	
当座預金残高	5,360,300		5,373,700		5,389,800	
準備預金残高	4,673,900					
積み終了先	4,673,600				7月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,673,600				積数	1,700
非準備預金先	686,400				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	41.94%		

●2021年7月28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▲0.065～▲0.015%の調達で始まった。一部の先で調達姿勢が後退していることもあり、レート水準は前日比で低下した。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発行市場は月末発行にあたり幅広い業態から発行が実施された。発行レートに変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/7/28	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.085	0.010	▲ 0.005	27,581.66	▲ 388.56	109.80-81	109.97-98
T/N							-	▲ 0.088						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.040	0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.009	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.108	▲ 0.104						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.129						
									日付	7/19	7/20	7/21	7/26	7/27
									日銀当預残	5,317,100	5,305,600	5,315,200	5,339,800	5,358,300
									準備預金残	4,659,100	4,615,100	4,631,800	4,652,100	4,666,900
									マネタリーベース	6,535,900	6,526,500	6,537,400	6,560,400	6,578,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.035%	▲ 0.035%	▲ 0.038%	▲ 0.038%	▲ 0.039%
									コール市場残高	158,932	162,047	174,254	162,969	160,294
									うち無担	137,777	143,658	154,517	142,328	140,200
									うちO/N	82,066	86,362	95,121	82,472	79,924
									うち有担	21,155	18,389	19,737	20,641	20,094

●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)
交付税特会	-	-	11,000	2021/8/6	2022/2/4	391,881.0	11,000.04		0.0000%	2.8070%		0.0000%	

●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	応募総額(億円・百万ドル)	着札総額(億円・百万ドル)	抜分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均着札レート・利回較差・価格較差	抜分比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/7/29			4,097	1,500	0.010		0.012	90.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/7/29			10,805	4,506	▲ 0.001		0.000	87.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/7/29			13,169	4,257	▲ 0.003		▲ 0.002	64.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/28	2021/7/29	▲ 0.350	438	438		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/28	2021/7/29	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月29日の予定

*米国4-6月期のGDP速報値

*2年利付国債入札
(30,000億円、8/2発行)

◆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