

Central Daily Market Report

2021年7月29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29日		2021年7月30日		2021年8月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		300		1,000	
財政	2,100		13,500		▲ 19,000	
資金過不足	1,300		13,800		▲ 18,000	
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	10,400					
CP等買入		▲ 100	5,000	▲ 3,900		
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	▲ 100	500		100		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	12,000		14,900		▲ 18,000	
当座預金残高	5,372,300		5,387,200		5,369,200	
準備預金残高	4,675,400					
積み終了先	4,675,000				7月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,675,000				積数	1,300
非準備預金先	696,900				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	99.97%	日数	45.16%		

●2021年7月29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▲0.07~▲0.015%の調達で始まった。積みの進捗ペースの違いで調達姿勢に差が生じている。一部の先では調達を控える動きも見られており、レート水準は前日比でやや低下した。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>

GCT/Nは、▲0.09~▲0.08%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発行市場は月初発行にあたり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。

●短期金融市場関連指標

2021/7/29	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	▲ 0.043				-	▲ 0.086	0.015	0.005	27,782.42	200.76	109.88-90	109.86-87
T/N							-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.029				-	▲ 0.090						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.025	▲ 0.013	▲ 0.021				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.108	▲ 0.104						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.129						
									日付	7/20	7/21	7/26	7/27	7/28
									日銀当預残	5,305,600	5,315,200	5,339,800	5,358,300	5,360,300
									準備預金残	4,615,100	4,631,800	4,652,100	4,666,900	4,673,900
									マネタリーベース	6,526,500	6,537,400	6,560,400	6,578,000	6,579,700
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.038%	▲0.038%	▲0.039%	▲0.041%
									コール市場残高	162,047	174,254	162,969	160,294	158,443
									うち無担	143,658	154,517	142,328	140,200	137,520
									うちO/N	86,362	95,121	82,472	79,924	76,144
									うち有担	18,389	19,737	20,641	20,094	20,923

●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)
2年利付国債	427	0.005%	30,000	2021/8/2	2023/8/1	101,599.0	24,275.00	100.2550	▲0.1220%	3.3441%	100.2630	▲0.1260%	5,720.0

●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)		2021/7/29	2021/7/30	▲ 0.350	106	106		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/29	2021/7/30	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月30日の予定

- *6月の完全失業率(市場予想:3.0%)
- *6月の有効求人倍率(市場予想:1.1倍)
- *6月の商業動態統計速報
- *6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
- 市場予想:前月比+5.0%
- *6月の住宅着工統計
- *米国6月の個人所得・消費支出
- *米国7月のシカゴPM景況感指数
- *ユーロ圏4-6月期のGDP1次速報
- *ユーロ圏7月の消費者物価指数速報値
- *国庫短期証券(1012回)入札(3ヶ月、53,000億円、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