

Central Daily Market Report

2021年7月30日(金)
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30日		2021年8月2日		2021年8月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		800		1,000	
財政	15,100		▲ 14,800		▲ 8,000	
資金過不足	15,400		▲ 14,000		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入	5,000	▲ 3,900		▲ 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		▲ 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				
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	16,500		▲ 14,200		▲ 7,000	
当座預金残高	5,388,800		5,374,600		5,367,600	
準備預金残高	4,691,600					
積み終了先	4,691,200		8月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,691,200		積数		300	
非準備預金先	697,200		1日平均		0	
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	99.99%	日数	54.84%		

●2021年7月30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。レート水準は月末要因もあり、調達を控える先も散見され、前日比でやや低下した。引き続き、積みの進捗状況に応じて各先まちまちの動きであった。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、▲0.09～▲0.08%程度での出会い。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TB3M物(1012回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは堅調に推移した。この他に1Y物のカレントで出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の業態から発行が見られたが、発行件数は少なかった。発行レートに変化は見られていない。

●短期金融市場関連指標

2021/7/30	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.150	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.083	0.015	0.000	27,283.59	▲ 498.83	109.41-42	109.52-54	
T/N							-	▲ 0.085							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.089							
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.092							
3W							-	▲ 0.094							
1M	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.021				-	▲ 0.098							
3M			▲ 0.028				▲ 0.110	▲ 0.104							
6M							▲ 0.129	▲ 0.116							
1Y							▲ 0.128	▲ 0.129							
										日付	7/21	7/26	7/27	7/28	7/29
										日銀当預残	5,315,200	5,339,800	5,358,300	5,360,300	5,372,300
										準備預金残	4,631,800	4,652,100	4,666,900	4,673,900	4,675,400
										マネタリーベース	6,537,400	6,560,400	6,578,000	6,579,700	6,592,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.038%	▲ 0.039%	▲ 0.041%	▲ 0.043%
										コール市場残高	174,254	162,969	160,294	158,443	156,558
										うち無担	154,517	142,328	140,200	137,520	137,024
										うちO/N	95,121	82,472	79,924	76,144	76,278
										うち有担	19,737	20,641	20,094	20,923	19,534

●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	1012	-	53,000	2021/8/2	2021/11/1	168,186.0	43,174.0	100.0255	▲0.1022%	9.0816%	100.0265	▲0.1062%	9,825.0

●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)		2021/7/30	2021/8/2	▲ 0.350	22	22		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/30	2021/8/2	▲ 0.350	0	0				

●2021年8月2日の予定

*7月の消費動向調査

*米国6月の建設支出

*米国7月のISM製造業景況指数

◆本資料は信頼できるとさ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