

Central Daily Market Report

2021年7月19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19日		2021年7月20日		2021年7月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 2,000		▲ 1,000	
財政	5,900		▲ 8,100		▲ 1,000	
資金過不足	4,900		▲ 10,100		▲ 2,000	
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						▲ 2,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 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				▲ 500		
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	4,400		▲ 11,000		▲ 4,400	
当座預金残高	5,317,100		5,306,100		5,301,700	
準備預金残高	4,659,100					
積み終了先	4,657,100		7月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,657,000		積数		6,200	
非準備預金先	658,000		1日平均		200	
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	99.83%	日数	12.90%		

●2021年7月19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~▲0.020%の調達で始まった。前日比でレート水準はほぼ横ばい圏で推移し、一巡後も同水準の出合いが続いた。ターム物はショートターム中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%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TB1Y物(1009回)の入札が実施され、やや強い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは堅調な展開となった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/7/19	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	▲ 0.035				-	▲ 0.089	0.014	▲ 0.001	27,652.74	▲ 350.34	109.88-89	109.84-86
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.009	▲ 0.021				-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.125	▲ 0.104						
6M							▲ 0.131	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.129						
									日付	7/12	7/13	7/14	7/15	7/16
									日銀当預残	5,319,700	5,312,700	5,295,400	5,306,700	5,312,700
									準備預金残	4,679,500	4,670,800	4,656,300	4,665,100	4,644,400
									マネタリーベース	6,536,200	6,528,800	6,511,500	6,523,600	6,530,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.035%	▲ 0.038%	▲ 0.043%	▲ 0.037%	▲ 0.035%
									コール市場残高	134,809	137,140	141,196	153,585	168,759
									うち無担	114,262	117,915	121,737	133,039	148,944
									うちO/N	60,386	63,579	67,351	81,453	96,263
									うち有担	20,547	19,225	19,459	20,546	19,815

●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	1009	-	35,000	2021/7/20	2022/7/20	120,058.0	28,530.7	100.1180	▲0.1178%	94.5600%	100.1180	▲0.1178%	6,469.0

●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)		2021/7/19	2021/7/20	▲ 0.350	86	86		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/19	2021/7/20	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2021/7/26			2,767	751	0.098		0.110	38.5

●2021年7月20日の予定

*6月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.2%	*米国6月の住宅着工件数	*国庫短期証券(1010回)入札 (6ヶ月、34,000億円、7/26発行)
		*流動性供給入札 (5,000億円、7/21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