

Central Daily Market Report

2021年7月21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21日 需給速報	2021年7月26日 需給予想	2021年7月27日 当社予想			
銀行券	▲ 1,300	1,800	0			
財政	10,100	9,200	9,000			
資金過不足	8,800	11,000	9,000			
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	4,000	▲ 2,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			14,100			
CP等買入		▲ 200	▲ 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		▲ 500	800	▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 118,200
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200	100		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増増減	9,600	25,800	▲ 109,200			
当座預金残高	5,315,200	5,341,000	5,231,800			
準備預金残高	4,634,100					
積み終了先	4,633,800			7月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,633,700			積数	2,700	
非準備預金先	681,100			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	99.93%	日数	32.26%		

●2021年7月21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。連休前であるものの地銀勢の調達レートには大きな変化は見られず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の引き合いが散見される程度であった。

<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TB3M物(1011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底堅く推移した。この他に、1Y物に出合いが見られた。

<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

2021/7/21	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	▲ 0.038				-	▲ 0.092	0.010	0.000	27,548.00	159.84	109.91-92	110.08-10
T/N	▲ 0.028	▲ 0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.038	▲ 0.009	▲ 0.025				-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.040	0.070	▲ 0.027				-	▲ 0.096						
3W	▲ 0.025	0.100	0.005				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.107	▲ 0.105						
6M							▲ 0.129	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.124	▲ 0.129						
									日付	7/14	7/15	7/16	7/19	7/20
									日銀当預残	5,295,400	5,306,700	5,312,700	5,317,100	5,305,600
									準備預金残	4,656,300	4,665,100	4,644,400	4,659,100	4,615,100
									マネタリーベース	6,511,500	6,523,600	6,530,500	6,535,900	6,526,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.043%	▲ 0.037%	▲ 0.035%	▲ 0.035%	▲ 0.035%
									コール市場残高	141,196	153,585	168,759	158,932	162,047
									うち無担	121,737	133,039	148,944	137,777	143,658
									うちO/N	67,351	81,453	96,263	82,066	86,362
									うち有担	19,459	20,546	19,815	21,155	18,389

●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	1011	-	53,000	2021/7/26	2021/10/25	153,443.3	43,331.2	100.0260	▲0.1042%	23.7862%	100.0274	▲0.1098%	9,668.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/7/30	2022/2/1	409,629.0	11,000.37		0.0000%	2.6855%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/7/26			10,706	4,507	0.002		0.004	86.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/7/26			11,834	4,503	0.002		0.003	34.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/7/26			13,081	4,260	▲0.001		0.000	26.5
国債買入(物価連動債)	600	2021/7/26			1,914	600	0.100		0.000	84.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/21	2021/7/26	▲ 0.350	192	192		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/21	2021/7/26	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月22日の予定

*海の日
*ECB定例理事会(金融政策発表)
*米国6月の中古住宅販売

●2021年7月23日の予定

*スポーツの日
*東京五輪開幕

●2021年7月26日の予定

*米国6月の新築一戸建て販売件数

◆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