

Central Daily Market Report

2021年5月31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5月31日		2021年6月1日		2021年6月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		500		1,000	
財政	▲ 5,400		▲ 40,000		▲ 45,000	
資金過不足	▲ 4,800		▲ 39,500		▲ 44,000	
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	11,400					
CP等買入	4,000	▲ 3,800				
貸出支援基金(成)					2,600	▲ 8,600
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	7,000		▲ 39,500		▲ 50,000	
当座預金残高	5,299,700		5,260,200		5,210,200	
準備預金残高	4,627,800					
積み終了先	4,627,500		6月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,627,500		積数		900	
非準備預金先	671,900		1日平均		100	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,743,300	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	51.61%		

●2021年5月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀業態を中心に▲0.05~▲0.008%の出会いで始まった。月末要因で調達を控える先が見られたこともあり、レートを引き下げる動きが加速した。一巡後は▲0.06~▲0.055%の出会いも見られた。ターム物は目立った出会いは見られず閑散だった。

<レポ市場>

GC T/N(6/1-6/2)は、▲0.10~▲0.09%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。個別銘柄では2Y410~424、5Y140~147、10Y345~362、20Y170~176、30Y59~70、40Y10~13等にビッドの出入りがあった。

<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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還が無く、発行総額は350億円程度と発行超であったが、小型案件のみの閑散としたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/5/31	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.093	0.075	▲ 0.005	28,860.08	▲ 289.33	109.90-91	109.71-72
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.101						
2W							-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M			▲ 0.003				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.108	▲ 0.109						
6M							▲ 0.112	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/24	5/25	5/26	5/27	5/28
									日銀当預残	5,267,500	5,292,300	5,295,900	5,285,000	5,292,700
									準備預金残	4,601,500	4,617,500	4,624,600	4,611,700	4,618,400
									マネタリーベース	6,476,100	6,500,900	6,505,300	6,495,500	6,503,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.016%	▲ 0.018%	▲ 0.021%	▲ 0.025%
									コール市場残高	165,754	164,730	163,379	163,114	164,727
									うち無担	144,010	144,610	143,867	141,534	142,763
									うちO/N	82,242	81,232	81,469	79,836	83,605
									うち有担	21,744	20,120	19,512	21,580	21,964

●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	425	0.005%	30,000	2021/6/1	2023/6/1	99,442.0	25,061.00	100.2600	▲0.1240%	72.2073%	100.2620	▲0.1250%	4,931.0

●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)		2021/5/31	2021/6/1	▲ 0.350	21	21		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/31	2021/6/1	▲ 0.350	0	0				

●2021年6月1日の予定

*1-3月期の法人企業統計調査季報	*米国4月の建設支出	*交付税特別会計借入(11,000億円、6/11借入)
	*米国5月のISM製造業景況指数	
	*ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値	

◆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