

Central Daily Market Report

2021年6月2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6月2日		2021年6月3日		2021年6月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		▲ 200		0	
財政	▲ 58,300		100		▲ 21,000	
資金過不足	▲ 58,100		▲ 100		▲ 21,000	
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	5,000					
国債買入			11,700			
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)	2,600	▲ 7,200				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 300	300		300		
※ドル資金供給用担保債提供						
当増減	▲ 57,800		11,700		▲ 21,000	
当座預金残高	5,193,200		5,204,900		5,183,900	
準備預金残高	4,557,100					
積み終了先	4,556,700				6月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,556,700				積数	200
非準備預金先	636,100				1日平均	0
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	99.99%	日数	58.06%		

●2021年6月2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▲0.068~▲0.015%の出会いで始まった。前日に続きギブン地合いのためレートは低下方向で推移した。一巡後は▲0.07%近辺の出会いが見られた。ターム物は出会いなく閑散だった。

<レポ市場>

GC T/N(6/3-6/4)は、▲0.095~▲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。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。発行市場は償還総額300億円程度に対して、発行総額は50億円程度と償還超であった。案件は少なく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

2021/6/2	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	
	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.081	0.075	0.000	28,946.14	131.80	109.49-50	109.77-78
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.008	▲ 0.018				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.013	▲ 0.005	▲ 0.009				-	▲ 0.092						
3W			0.030				-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.108	▲ 0.107						
6M							▲ 0.112	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/26	5/27	5/28	5/31	6/1
									日銀当預残	5,295,900	5,285,000	5,292,700	5,299,700	5,251,000
									準備預金残	4,624,600	4,611,700	4,618,400	4,626,800	4,599,400
									マネタリーベース	6,505,300	6,495,500	6,503,400	6,509,700	6,460,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.021%	▲ 0.025%	▲ 0.034%	▲ 0.038%
									コール市場残高	163,379	163,114	164,727	154,383	163,121
									うち無担	143,867	141,534	142,763	134,658	140,661
									うちO/N	81,469	79,836	83,605	79,700	85,748
									うち有担	19,512	21,580	21,964	19,725	22,460

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)	4,750	2021/6/3			18,187	4,762	0.000		0.001	17.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/6/3			11,315	4,509	0.000		0.001	3.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2021/6/3			6,445	2,010	0.004		0.005	54.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/2	2021/6/3	▲ 0.350	337	337		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/2	2021/6/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/4	2021/6/10	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/4	2021/8/26	0.330	0	0				

●2021年6月3日の予定

*6月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国5月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札(26,000億円、6/4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