

Central Daily Market Report

2021年6月4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6月4日		2021年6月7日		2021年6月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		700		0	
財政	▲ 22,200		0		2,000	
資金過不足	▲ 21,600		700		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
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	200		100		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 21,800		700		2,000	
当座預金残高	5,183,200		5,183,900		5,185,900	
準備預金残高	4,575,800					
積み終了先	4,575,800		6月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,575,800		積数	100		
非準備預金先	607,400		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	100.00%	日数	70.97%		

●2021年6月4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▲0.055~▲0.01%の出会いで始まった。積み期間も後半に入り、3日積み要因による調達サイドの積みの進捗調整に加え、運用サイドの資金放出ニーズがやや減退していることから、レートは前日比で上昇となった。ターム物はショートターム物で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(6/7-6/8)は、▲0.08~▲0.07%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>

本日はTB3M物(998回)の入札が実施され、WI取引において▲0.102~▲0.101%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1018%、按分落札利回▲0.0982%と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▲0.105%出会いと、堅調に推移した。

<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50億円程度に対して、発行総額は650億円程度と発行超であった。案件数は膨らまず比較的落ち着い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

2021/6/4	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				-	▲ 0.076	0.082	0.002	28,941.52	▲ 116.59	110.28-29	110.18-19
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.015	0.095	0.011				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.088						
1M	▲ 0.018	0.150	0.015				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.105	▲ 0.103						
6M							▲ 0.112	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.135						
									日付	5/28	5/31	6/1	6/2	6/3
									日銀当預残	5,292,700	5,299,700	5,251,000	5,193,200	5,205,000
									準備預金残	4,618,400	4,626,800	4,599,400	4,557,100	4,577,500
									マネタリーベース	6,503,400	6,509,700	6,460,600	6,402,500	6,414,400
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.034%	▲0.038%	▲0.043%	▲0.037%
									コール市場残高	164,727	154,383	163,121	151,064	143,088
									うち無担	142,763	134,658	140,661	130,922	123,979
									うちO/N	83,605	79,700	85,748	75,859	69,028
									うち有担	21,964	19,725	22,460	20,142	19,109

●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	998	-	63,000	2021/6/7	2021/9/6	178,943.9	51,438.2	100.0245	▲0.0982%	51.0946%	100.0254	▲0.1018%	11,561.0

●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)		2021/6/4	2021/6/7	▲ 0.350	73	73		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/4	2021/6/7	▲ 0.350	0	0				

●2021年6月7日の予定

*4月の景気動向指数速報	*米国4月の消費者信用残高
*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引	

◆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