

Central Daily Market Report

2021年6月7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6月7日		2021年6月8日		2021年6月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		500		1,000	
財政	▲ 1,100		600		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 400		1,100		▲ 12,000	
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						▲ 3,400
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						
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	100		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 600		1,200		▲ 15,400	
当座預金残高	5,182,600		5,183,800		5,168,400	
準備預金残高	4,570,700					
積み終了先	4,570,700				6月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,570,700				積数	100
非準備預金先	611,900				1日平均	0
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						3,750,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%		

●2021年6月7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▲0.055~▲0.01%での調達で始まった。先週末比でレート水準に大きな変化はなく、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(6/8-6/9)は、▲0.075~▲0.06%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。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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。償還総額200億円程度に対して、発行総額は400億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/6/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.032				-	▲ 0.069	0.075	▲ 0.007	29,019.24	77.72	109.61-62	109.42-43
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.077						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.105	▲ 0.102						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.134						
									日付	5/31	6/1	6/2	6/3	6/4
									日銀当預残	5,299,700	5,251,000	5,193,200	5,205,000	5,183,200
									準備預金残	4,626,800	4,599,400	4,557,100	4,577,500	4,575,800
									マネタリーベース	6,509,700	6,460,600	6,402,500	6,414,400	6,392,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.034%	▲ 0.038%	▲ 0.043%	▲ 0.037%	▲ 0.034%
									コール市場残高	154,383	163,121	151,064	143,088	152,480
									うち無担	134,658	140,661	130,922	123,979	131,800
									うちO/N	79,700	85,748	75,859	69,028	76,519
									うち有担	19,725	22,460	20,142	19,109	20,680

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/7	2021/6/8	▲ 0.350	186	186		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/7	2021/6/8	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1250	2021/6/10			2,263	1,252	▲ 0.057		▲ 0.050	90.4

●2021年6月8日の予定

*1-3月期のGDP2次速報 市場予想：前年比年率▲4.8%	*米国4月の貿易収支 *ユーロ圏1-3月期のGDP確報値	*30年利付国債入札 (9,000億円、6/9発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、6/18借入)
*4月の毎月勤労統計調査速報 *4月の国際収支 *4月の特定サービス産業動態統計速報 *5月の景気ウォッチャー調査		

◆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