

Central Daily Market Report

2021年6月8日(火)

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8日		2021年6月9日		2021年6月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		100		▲ 1,000	
財政	6,500		▲ 12,800		▲ 7,000	
資金過不足	7,000		▲ 12,700		▲ 8,000	
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	▲ 3,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			15,000			
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				▲ 100	1,300	
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確保供給						
当増減	7,100		2,100		▲ 6,700	
当座預金残高	5,189,700		5,191,800		5,185,100	
準備預金残高	4,588,100					
積み終了先	4,588,100				6月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,588,100				積数	100
非準備預金先	601,600				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	77.42%		

●2021年6月8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▲0.05~▲0.01%での調達で始まった。前日比でレート水準は若干上昇し、一巡後は▲0.02%近辺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>

GCT/N(6/9-6/10)は、▲0.06~▲0.075%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>

本日は短国買入オペが前回から1兆円増額の1兆5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.007%、全取利回較差+0.007%と、弱めの結果となった。マーケット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発行市場は鉄鋼、石油・石炭業態において大型発行が実施された。償還総額1,550億円程度に対して、発行総額は1,600億円程度と若干の発行超となった。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

2021/6/8	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.064	0.070	▲ 0.005	28,963.56	▲ 55.68	109.27-28	109.52-53
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.075						
2W	▲ 0.010	▲ 0.009	▲ 0.010				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.086						
1M			▲ 0.009				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.104	▲ 0.102						
6M							▲ 0.108	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.133						
									日付	6/1	6/2	6/3	6/4	6/7
									日銀当預残	5,251,000	5,193,200	5,205,000	5,183,200	5,182,600
									準備預金残	4,599,400	4,557,100	4,577,500	4,575,800	4,570,700
									マネタリーベース	6,460,600	6,402,500	6,414,400	6,392,100	6,390,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.043%	▲ 0.037%	▲ 0.034%	▲ 0.032%
									コール市場残高	163,121	151,064	143,088	152,480	134,458
									うち無担	140,661	130,922	123,979	131,800	114,013
									うちO/N	85,748	75,859	69,028	76,519	59,470
									うち有担	22,460	20,142	19,109	20,680	20,445

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	70	0.700%	9,000	2021/6/9	2051/3/20	24,792.0	7,318.0	100.0500	0.6970%	5.8287%	100.1500	0.6930%	1,673	
交付税特会	-	-	11,000	2021/6/18	2021/12/17	428,192.0	10,990.09		0.0000%	2.5667%		0.0000%		10.0

●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)	貸付レート・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	貸分比率
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2021/6/9	2021/6/23		3,351	3,351				
国庫短期証券買入	15,000	2021/6/9			37,545	15,000		0.007	0.007	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/8	2021/6/9	▲ 0.350	4	4		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/8	2021/6/9	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/10	2021/6/17	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/10	2021/9/2	0.330	0	0				

●2021年6月9日の予定

*5月のマネーストック	*米国4月の卸売売上高	*国庫短期証券(999回)入札 (6ヶ月、34,000億円、6/10発行)
-------------	-------------	--

◆本資料は信頼できるとさ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