

Central Daily Market Report

2021年6月9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9日		2021年6月10日		2021年6月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 12,200		▲ 5,000		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 12,100		▲ 5,400		▲ 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	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			14,600			
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					600	▲ 500
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						
国債補充供給						
*ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	2,700		10,200		▲ 1,900	
当座預金残高	5,192,400		5,202,600		5,200,700	
準備預金残高	4,585,500					
積み終了先	4,585,500		6月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,585,500		積数		0	
非準備預金先	606,900		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	80.65%		

●2021年6月9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▲0.045~▲0.01%での調達で始まった。積みみの終盤に差し掛かり、着地に向けた調整でレートを切り上げる先が一部で見られたことから、前日比でレート水準は若干上昇した。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(6/10-6/11)は、▲0.07~▲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>

本日はTB6M物(999回)の入札が実施され、WI取引において▲0.100%近辺での気配が見られる中、平均落札利回▲0.1016%、按分落札利回▲0.0996%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%出合いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場はその他金融業態において大型発行が実施された。償還総額1,100億円程度に対して、発行総額は850億円程度と償還超となった。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

2021/6/9	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.063	0.065	▲ 0.005	28,860.80	▲ 102.76	109.47-48	109.44-45
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.011	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.068						
2W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.085						
1M			0.080				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.104	▲ 0.101						
6M							▲ 0.105	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.133						
									日付	6/2	6/3	6/4	6/7	6/8
									日銀当預残	5,193,200	5,205,000	5,183,200	5,182,600	5,189,700
									準備預金残	4,557,100	4,577,500	4,575,800	4,570,700	4,588,100
									マネタリーベース	6,402,500	6,414,400	6,392,100	6,390,800	6,397,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.043%	▲ 0.037%	▲ 0.034%	▲ 0.032%	▲ 0.029%
									コール市場残高	151,064	143,088	152,480	134,458	141,070
									うち無担	130,922	123,979	131,800	114,013	121,665
									うちO/N	75,859	69,028	76,519	59,470	65,702
									うち有担	20,142	19,109	20,680	20,445	19,405

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	999	-	34,000	2021/6/10	2021/12/10	113,760.0	27,762.3	100.0500	▲0.0996%	92.3390%	100.0510	▲0.1016%	6,237.0

●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	応募総額(億円・百万ドル)	発注総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/6/10			19,442	4,752	0.005		0.006	43.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/6/10			13,190	4,506	▲0.001		▲0.001	89.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/6/10			10,204	4,507	▲0.005		▲0.003	2.4
国債買入(物債連動債)	600	2021/6/10			3,318	603	▲0.330		▲0.352	37.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/9	2021/6/10	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/9	2021/6/10	▲ 0.350	0	0				
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
被災地金融支援オペ	第12回	2021/6/11		596						

●2021年6月10日の予定

*5月の企業物価指数	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*流動性供給入札(5,000億円、6/11発行)
	*米国5月の財政収支	*エネルギー対策借入(8,000億円、6/21借入)
	*米国5月の消費者物価指数	

◆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