

# Central Daily Market Report

2021年6月11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11日		2021年6月14日		2021年6月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲100				0
財政	▲2,100		4,000			78,000
資金過不足	▲2,000		3,900			78,000
<b>金融調節</b>	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		▲900		▲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						
新型コロナ対応金融支援特別		▲200				
E T F 買入						
国債補完供給	▲500	200		500		
<small>※ドル資金供給用担保貸付供給</small>						
当預増減	▲3,300		4,100			78,000
当座預金残高	5,197,800		5,201,900			5,279,900
準備預金残高	4,612,700					
積み終了先	4,612,700			6月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,612,700			積数	0	
非準備預金先	585,100			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	93.55%		

## ●2021年6月11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▲0.03~▲0.005%での調達で始まった。今積み期最後の週末3日積みということもあり、着地に向けた調達ニーズは強く、一巡後も▲0.01%近辺の出合いが見られた。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(6/14-6/15)は、▲0.08~▲0.065%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TB3M物(1000回)の入札が実施され、WI取引において▲0.105~▲0.100%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1022%、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▲0.110~▲0.102%出合いと、堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.107~▲0.106%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場はゴム製品業態において大型発行が実施されたほか、機械業態においてもまとまった額の発行が実施された。償還総額3,200億円程度に対して、発行総額は1,200億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

2021/6/11	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	▲0.016				-	▲0.071	0.030	▲0.015	28,948.73	▲9.83	109.38-40	109.43-44
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.006				-	▲0.073						
S/N							-	-						
1W			▲0.010				-	▲0.076						
2W							-	▲0.081						
3W							-	▲0.087						
1M							-	▲0.093						
3M							▲0.103	▲0.102						
6M							▲0.106	▲0.114						
1Y							▲0.128	▲0.133						
									日付	6/4	6/7	6/8	6/9	6/10
									日銀当預残	5,183,200	5,182,600	5,189,700	5,192,400	5,201,100
									準備預金残	4,575,800	4,570,700	4,588,100	4,585,600	4,585,000
									マネタリーベース	6,392,100	6,390,800	6,397,400	6,400,000	6,409,100
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.032%	▲0.029%	▲0.026%	▲0.022%
									コール市場残高	152,480	134,458	141,070	135,339	145,014
									うち無担	131,800	114,013	121,665	115,406	125,553
									うちO/N	76,519	59,470	65,702	60,043	64,960
									うち有担	20,680	20,445	19,405	19,933	19,461

## ●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	1000	-	60,000	2021/6/14	2021/9/13	184,729.5	48,989.1	100.0245	▲0.0982%	6.5779%	100.0255	▲0.1022%	11,010.0

## ●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)		2021/6/11	2021/6/14	▲0.350	509	509		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/11	2021/6/14	▲0.350	0	0				

## ●2021年6月14日の予定

特にありません。

◆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