

Central Daily Market Report

2021年6月14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14日		2021年6月15日		2021年6月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		100		▲ 1,000	
財政	1,600		79,100		▲ 17,000	
資金過不足	1,400		79,200		▲ 18,000	
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			7,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
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	▲ 300	500		300		
<small>※ドル資金供給用担保債供給</small>						
当増減	1,300		86,400		▲ 18,000	
当座預金残高	5,199,100		5,285,500		5,267,500	
準備預金残高	4,622,500					
積み終了先	4,622,500				6月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,622,500				積数	0
非準備預金先	576,600				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	96.77%		

●2021年6月14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～▲0.003%での調達で始まった。一巡後は▲0.025%近辺での出合いが散見される程度で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(6/15-6/16)は、▲0.085～▲0.07%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＞

本日は短国買入オベが前回から7,500億円減額の7,500億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差+0.001%と無難な結果となった。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、償還総額は200億円程度に対し発行総額は少額で閑散。発行レートは、概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入オベが、予定通りの5,000億円でオファーされた。平均落札レート▲0.004%、按分レート▲0.006%と、前回比で平均・按分共に上昇した。

●短期金融市場関連指標

2021/6/14	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.071	0.035	0.005	29,161.80	213.07	109.71-72	109.69-70
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.015	0.150	0.004				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.030	0.050	▲ 0.002				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.103	▲ 0.103						
6M							▲ 0.106	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.132						
									日付	6/7	6/8	6/9	6/10	6/11
									日銀当預残	5,182,600	5,189,700	5,192,400	5,201,100	5,197,800
									準備預金残	4,570,700	4,588,100	4,585,600	4,585,000	4,612,700
									マネタリーベース	6,390,800	6,397,400	6,400,000	6,409,100	6,405,700
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.029%	▲0.026%	▲0.022%	▲0.016%
									コール市場残高	134,458	141,070	135,339	145,014	146,852
									うち無担	114,013	121,665	115,406	125,553	127,467
									うちO/N	59,470	65,702	60,043	64,960	68,194
									うち有担	20,445	19,405	19,933	19,461	19,385

●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	業分率	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
国庫短期証券買入	7,500	2021/6/15			21,698	7,503	0.001		0.002	76.6
CP等買入	5,000	2021/6/17			9,926	4,991	▲0.006		▲0.004	13.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/14	2021/6/15	▲ 0.350	315	315		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/14	2021/6/15	▲ 0.350	0	0				

●2021年6月15日の予定

*4月の第3次産業活動指数	*米国FOMC(1日目) *米国4月の企業在庫 *米国5月の生産者物価指数 *米国5月の小売売上高 *米国5月の鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1001回)入札 (6ヶ月、34,000億円、6/16発行) *流動性供給入札 (5,000億円、6/16発行)
---------------	---	---

◆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