Central Daily Market Report

2021年6月15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15日 需給速報		2021年6月16日 需給予想		2021年6月17日 当社予想	
銀行券	100		▲ 300		▲ 1,000	
財政	81,400		▲ 14,500		3,000	
資金過不足	81,500		▲ 14,800		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						
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		▲ 600		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						▲ 26,400
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	88,600		▲ 15,200		▲ 24,400	

当座預金残高	5,287,700	5,272,500	5,248,100
準備預金残高	4,657,100		
積み終了先	4,657,100		
超過準備	4,657,100		
非準備預金先	630,600		

6月16日以降の残り所要積立額	
積数	3,632,600
1日平均	121,100

積み期間（6/16～7/15）の所要準備額	3,632,600

準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%

●2021年6月15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▲0.02～▲0.003%での調達で始まった。積み最終日にあたることから、一部取り上がる先が見られた。一巡後は▲0.025～▲0.015%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(6/16-6/17)は、▲0.09～▲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TB6M物（1001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▲0.1036%、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▲0.106%の出合いが見られるなど、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は300億円程度に対し発行総額は1,000億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/6/15	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.013				－	▲ 0.076
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.086
S/N			▲ 0.015				－	－
1W	▲ 0.015	▲ 0.012	▲ 0.013				－	▲ 0.086
2W	▲ 0.045	▲ 0.005	▲ 0.022				－	▲ 0.088
3W			0.010				－	▲ 0.095
1M			▲ 0.010				－	▲ 0.098
3M							▲ 0.103	▲ 0.103
6M							▲ 0.106	▲ 0.114
1Y							▲ 0.115	▲ 0.132

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.045	0.010	29,441.30	279.50	110.03-05	110.04-05

日付	6/8	6/9	6/10	6/11	6/14
日銀当預残	5,189,700	5,192,400	5,201,100	5,197,800	5,199,100
準備預金残	4,588,100	4,585,600	4,585,000	4,612,700	4,622,500
マネタリーベース	6,397,400	6,400,000	6,409,100	6,405,700	6,407,200
無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.026%	▲0.022%	▲0.016%	▲0.015%
コール市場残高	141,070	135,339	145,014	146,852	140,527
うち無担	121,665	115,406	125,553	127,467	120,397
うちO/N	65,702	60,043	64,960	68,194	67,874
うち有担	19,405	19,933	19,461	19,385	20,130

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1001	－	34,000	2021/6/16	2021/12/16	129,494.0	27,762.20	100.0500	▲0.0996%	10.7480%	100.0520	▲0.1036%	6,237.0
流動性供給	336	－	5,000	2021/6/16		10,895.0	4,988.0		0.0080%	72.7804%		0.0050%	

●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）		2021/6/15	2021/6/16	▲ 0.350	50	50		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/6/15	2021/6/16	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/17	2021/6/24	0.330	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/17	2021/9/10	0.330	0	0				

●2021年6月16日の予定

*4月の機械受注統計
　市場予想：電力除く民需、前月比＋2.7%
*4月の石油等消費動態統計
*5月の貿易統計
*米国FOMC（2日目）
*米国FRB経済見通し発表
*米国5月の住宅着工件数
*英国5月の消費者物価指数
*国庫短期証券（1002回）入札
（1年、35,000億円、6/21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。
◆本資料は何ら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論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