

Central Daily Market Report

2021年6月16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16日		2021年6月17日		2021年6月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	▲ 12,500		3,800		15,000	
資金過不足	▲ 12,800		2,600		14,000	
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						
国債買入			14,000			
CP等買入		▲ 400	5,000			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					26,500	▲ 26,400
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	▲ 100			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補充供給		100				
*ドル資金供給用担保準備供給						
当増減	▲ 13,200		21,500		14,100	
当座預金残高	5,274,500		5,296,000		5,310,100	
準備預金残高	4,632,900					
積み終了先	3,297,700		6月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	1,378,400		積数	378,200		
非準備預金先	641,600		1日平均	13,000		
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	89.59%	日数	3.33%		

●2021年6月16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▲0.060~▲0.005%での調達で始まった。新積み期を迎え、取り手の様子見姿勢からレートは低下した。一巡後は▲0.060%近辺で調整の出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、期內物で引き合いが散見されていた。

<レポ市場>

GC T/N(6/17-6/18)は、▲0.085~▲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TB1Y物(1002回)の入札が実施され、WI取引において▲0.111~▲0.108%で出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1161%、按分落札利回▲0.1091%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▲0.114~▲0.112%の出合いが見られるなど、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は2,000億円程度に対し、発行総額は2,200億円程度となった。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

2021/6/16	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	▲ 0.008	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.081	0.045	0.000	29,291.01	▲ 150.29	110.08-09	109.93-94
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.017	▲ 0.007	▲ 0.012				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.037	▲ 0.004	▲ 0.013				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.093						
1M	▲ 0.005	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.103	▲ 0.102						
6M							▲ 0.106	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.113	▲ 0.132						
									日付	6/9	6/10	6/11	6/14	6/15
									日銀当預残	5,192,400	5,201,100	5,197,800	5,199,100	5,287,700
									準備預金残	4,585,600	4,585,000	4,612,700	4,622,500	4,657,100
									マネタリーベース	6,400,000	6,409,100	6,405,700	6,407,200	6,495,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.026%	▲ 0.022%	▲ 0.016%	▲ 0.015%	▲ 0.013%
									コール市場残高	135,339	145,014	146,852	140,527	146,482
									うち無担	115,406	125,553	127,467	120,397	127,507
									うちO/N	60,043	64,960	68,194	67,874	78,344
									うち有担	19,933	19,461	19,385	20,130	18,975

●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	1002	-	35,000	2021/6/21	2022/6/20	85,857.0	28,574.7	100.1090	▲0.1091%	30.1993%	100.1160	▲0.1161%	6,424.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万円)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万円)	落札総額(億円・百万円)	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/6/17			15,425	4,755	0.004		0.004	72.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/6/17			9,811	4,505	0.002		0.003	47.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/6/17			11,852	4,511	0.005		0.006	1.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/16	2021/6/17	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/16	2021/6/17	▲ 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)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2021/6/18	2025/6/18	0	26,498

●2021年6月17日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(1日目)

*5月のユーロ圏消費者物価指数改定値

*国庫短期証券(1003回)入札
(3ヶ月、60,000億円、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