

# Central Daily Market Report

2021年6月17日(木)

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17日		2021年6月18日		2021年6月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 500			0
財政	4,400		9,200			50,000
資金過不足	3,200		8,700			50,000
<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	14,000					
CP等買入	5,000			▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			26,500	▲ 24,100		
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 800		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 600			600		
※ドル資金供給用担保債供給						
当預増減	21,500		10,500			50,000
当座預金残高	5,296,000		5,306,500			5,356,500
準備預金残高	4,649,300					
積み終了先	4,623,200				6月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,290,100				積数	19,000
非準備預金先	646,700				1日平均	700
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	99.48%	日数	6.67%		

## ●2021年6月17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▲0.050~▲0.005%での調達で始まった。一巡後は▲0.050%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、期内物で引き合いが散見されていた。

### <レポ市場>

GC T/N(6/18-6/21)は、▲0.085%~▲0.075%程度での出合い。SCI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(1003回)の入札が実施され、WI取引において▲0.103%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.101%、按分落札利回▲0.0991%と、無難な結果だった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは特段の出合いは見られなかったものの、▲0.099%の買い気配が見られるなど、底堅く推移した。この他に、1Y物が▲0.115%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,400億程度に対し発行総額は1,700億程度。発行レートは、概ね横ばい圏だった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/6/17	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.082	0.060	0.015	29,018.33	▲ 272.68	110.77-78	110.59-60
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.084						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.015				-	▲ 0.086						
2W							-	▲ 0.089						
3W			0.002				-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.095						
3M			0.011				▲ 0.101	▲ 0.101						
6M							▲ 0.108	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	6/10	6/11	6/14	6/15	6/16
									日銀当預残	5,201,100	5,197,800	5,199,100	5,287,700	5,274,500
									準備預金残	4,585,000	4,612,700	4,622,500	4,657,100	4,632,900
									マネタリーベース	6,409,100	6,405,700	6,407,200	6,495,600	6,482,800
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.013%	▲0.034%
									コール市場残高	145,014	146,852	140,527	146,482	156,224
									うち無担	125,553	127,467	120,397	127,507	135,412
									うちO/N	64,960	68,194	67,874	78,344	80,441
									うち有担	19,461	19,385	20,130	18,975	20,812

## ●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	1003	-	60,000	2021/6/21	2021/9/21	176,567.3	48,984.0	100.0250	▲0.0991%	33.0790%	100.0255	▲0.1011%	11,015.0

## ●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)		2021/6/17	2021/6/18	▲ 0.350	559	559		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/17	2021/6/18	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年6月18日の予定

- \*日銀政策委・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- \*黒田日銀総裁定例会見
- \*5月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.1%)

◆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