

# Central Daily Market Report

2021年6月18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18日		2021年6月21日		2021年6月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 300			0
財政	10,900		47,900			2,000
資金過不足	10,400		47,600			2,000
<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		▲ 400		▲ 500		
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		▲ 800				
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	600		100		
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	12,100		47,200			2,000
当座預金残高	5,308,100		5,355,300			5,357,300
準備預金残高	4,658,400					
積み終了先	4,657,900		6月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,653,700		積数 4,800			
非準備預金先	649,700		1日平均 200			
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	99.87%	日数	16.67%		

## ●2021年6月18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。週末3日積みにあたることから、取り手サイドの調達意欲は堅調であった。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(6/21-6/22)は、▲0.09~▲0.08%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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物が▲0.102~▲0.100%、6M物が▲0.105%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,400億円程度に対し発行総額は1,700億円程度となった。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

2021/6/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.081	0.055	▲ 0.005	28,964.08	▲ 54.25	110.32-33	110.00-01
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.084						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.089						
3W			0.170				-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.007				-	▲ 0.096						
3M			0.011				▲ 0.102	▲ 0.101						
6M							▲ 0.105	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	6/11	6/14	6/15	6/16	6/17
									日銀当預残	5,197,800	5,199,100	5,287,700	5,274,500	5,296,000
									準備預金残	4,612,700	4,622,500	4,657,100	4,632,900	4,649,300
									マネタリーベース	6,405,700	6,407,200	6,495,600	6,482,800	6,505,500
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.015%	▲0.013%	▲0.034%	▲0.028%
									コール市場残高	146,852	140,527	146,482	156,224	162,831
									うち無担	127,467	120,397	127,507	135,412	142,787
									うちO/N	68,194	67,874	78,344	80,441	87,096
									うち有担	19,385	20,130	18,975	20,812	20,044

## ●入札結果

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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/18	2021/6/21	▲ 0.350	92	92		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/18	2021/6/21	▲ 0.350	0	0				

## ●日銀政策決定会合・結果

### ●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定。

- (1) 新型コロナウイルス対応資金繰り支援特別プログラムの延長(賛成8棄権1)  
企業等の資金繰りは、一頃より改善しているが、新型コロナウイルス感染症の影響からストレスのかかる状況が続くとみられる。こうした情勢を踏まえ、引き続き、企業等の資金繰りを支援していく観点から、新型コロナウイルス対応資金繰り支援特別プログラムについて、期限を2022年3月末まで半年間延長する。
- (2) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対1棄権1) 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。  
短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。  
長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
- (3) 資産買入れ方針(賛成8棄権1) 長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。  
①ETFおよびJ-REITについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。  
②CP等、社債等については、2022年3月末までの間、合計で約20兆円の残高を上限に、買入れを行う。
2. 日本銀行は、気候変動関連分野での民間金融機関の多様な取り組みを支援するため、金融機関が自らの判断に基づき取り組む気候変動対応融資をバックファイナンスする新たな資金供給の仕組みを導入することが適当と判断した。この新たな仕組みは、成長基盤強化支援資金供給制度の後継と位置付けるが(同制度の新規貸付は現在の期限である2022年6月をもって終了)、同制度の終了を待たずに、年内を目途に実施する。なお、その骨子素案を、7月の金融政策決定会合で公表する予定である。

◆本資料は信頼できるとさ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