

Central Daily Market Report

2021年6月21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21日		2021年6月22日		2021年6月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 400		▲ 1,000	
財政	46,400		▲ 100		▲ 27,000	
資金過不足	46,000		▲ 500		▲ 28,000	
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						▲ 3,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			12,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 200		
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	▲ 200	100		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	45,400		12,000		▲ 31,400	
当座預金残高	5,353,500		5,365,500		5,334,100	
準備預金残高	4,684,400					
積み終了先	4,683,900				6月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,683,900				積数	4,300
非準備預金先	669,100				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	99.88%	日数	20.00%		

●2021年6月21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▲0.05~▲0.015%での調達で始まった。先週末は連休を跨ぐ取引でやや強含んだが、ほぼ同水準での出会いとなった。一巡後は▲0.05~▲0.02%近辺の出会いが数件見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/22-6/23)は、▲0.085~▲0.075%程度での出会い。SCはローラー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2Y410~425、5Y140~147、10Y345~362、20Y170~176、30Y59~70、40Y10~14等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日は短国買入オペが前回から5,000億円増額の1兆2,500億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.004%、按分落札利回較差+0.003%と、やや弱い結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、1Y物が▲0.115~▲0.113%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還は小規模だったものの、機械・小売・商社等がまとまった発行を行ったため、発行総額は2,500億円強に膨らんだ。発行レートは、一部の発行残高が少ない銘柄で、堅調な玉確保ニーズを反映した決着も見られたが、概ね横ばい圏で決着した。

●短期金融市場関連指標

2021/6/21	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	▲ 0.026				-	▲ 0.083	0.040	▲ 0.015	28,010.93	▲ 953.15	110.20-21	110.02-04
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.015	▲ 0.032				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.095						
3M			0.011				▲ 0.099	▲ 0.101						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	6/14	6/15	6/16	6/17	6/18
									日銀当預残	5,199,100	5,287,700	5,274,500	5,296,000	5,308,100
									準備預金残	4,622,500	4,657,100	4,632,900	4,649,300	4,659,000
									マネタリーベース	6,407,200	6,495,600	6,482,800	6,505,500	6,518,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.013%	▲ 0.034%	▲ 0.028%	▲ 0.027%
									コール市場残高	140,527	146,482	156,224	162,831	173,268
									うち無担	120,397	127,507	135,412	142,787	153,350
									うちO/N	67,874	78,344	80,441	87,096	94,279
									うち有担	20,130	18,975	20,812	20,044	19,918

●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	案分率	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	12,500	2021/6/22			49,582	12,505	0.003		0.004	27.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/21	2021/6/22	▲ 0.350	183	183		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/21	2021/6/22	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2021/6/24			2,326	751	0.093		0.105	14.3

●2021年6月22日の予定

*米国5月の中古住宅販売	*5年利付国債入札(25,000億円、6/23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