

# Central Daily Market Report

2021年6月22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22日		2021年6月23日		2021年6月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 900		▲ 2,000	
財政	1,600		▲ 27,000		1,000	
資金過不足	1,200		▲ 27,900		▲ 1,000	
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			3,800	▲ 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		▲ 200		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
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						
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	13,700		▲ 28,200		▲ 200	
当座預金残高	5,367,200		5,339,000		5,338,800	
準備預金残高	4,711,000					
積み終了先	4,710,500				6月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,710,500				積数	3,800
非準備預金先	656,200				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	99.90%	日数	23.33%		

## ●2021年6月22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▲0.045~▲0.01%での調達で始まった。前日比でレート水準はほぼ横ばい圏で推移し、一巡後は▲0.055~▲0.025%近辺の出会いが見られた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/23-6/24)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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、2,300億円程度の償還が見られたが、ノンバンクからまとまった発行が見られた程度で、小口の案件が中心であったため、750億円程度の発行にとどまる償還超となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/6/22	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.084	0.050	0.010	28,884.13	873.20	110.38-39	110.48-50
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.002	▲ 0.013				-	▲ 0.086						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.099	▲ 0.102						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	6/15	6/16	6/17	6/18	6/21
									日銀当預残	5,287,700	5,274,500	5,296,000	5,308,100	5,353,500
									準備預金残	4,657,100	4,632,900	4,649,300	4,659,000	4,684,400
									マネタリーベース	6,495,600	6,482,800	6,505,500	6,518,100	6,563,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.034%	▲ 0.028%	▲ 0.027%	▲ 0.026%
									コール市場残高	146,482	156,224	162,831	173,268	162,081
									うち無担	127,507	135,412	142,787	153,350	141,708
									うちO/N	78,344	80,441	87,096	94,279	81,517
									うち有担	18,975	20,812	20,044	19,918	20,373

## ●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)
5年利付国債	147	0.005%	25,000	2021/6/23	2026/3/20	77,631.0	20,485.00	100.4600	▲0.0910%	13.5078%	100.4900	▲0.0970%	4,509.0

## ●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)	発札総額(億円・百万ドル)	抜分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均発札レート・利回較差・価格較差	抜分比率
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2021/6/23	2021/7/7		3,751	3,751				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/22	2021/6/23	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/22	2021/6/23	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/24	2021/7/1	0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/6/24	2021/9/16	0.350	0	0				

## ●2021年6月23日の予定

\*金融政策決定会合議事要旨(4月26、27日分)  
\*4月の景気動向指数改訂状況

\*米国5月の新築一戸建て販売件数

◆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