

# Central Daily Market Report

2021年6月23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23日		2021年6月24日		2021年6月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 1,700		▲ 2,000	
財政	▲ 24,800		1,300		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 25,700		▲ 400		▲ 5,000	
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						
国債買入			11,000			
CP等買入		▲ 700		▲ 500		
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						▲ 99,700
E T F買入						
国債補充供給						
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 26,000		10,900		▲ 104,700	
当座預金残高	5,341,200		5,352,100		5,247,400	
準備預金残高	4,678,000					
積み終了先	4,677,700		6月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,677,600		積数		3,300	
非準備預金先	663,200		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	99.91%	日数	26.67%		

## ●2021年6月23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(6/24-6/25)は、▲0.085~▲0.075%程度での出会い。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2Y410~425、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、2,700億円程度の償還総額に対して、2,300億円程度の発行総額となる償還超のマーケットであった。陸運・鉄鋼等が大ロットの発行を実施し、発行総額を押し上げた。発行レートに目立った変動は見られていない。

## ●短期金融市場関連指標

2021/6/23	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	▲ 0.028				-	▲ 0.083	0.050	0.000	28,874.89	▲ 9.24	110.64-66	110.87-89
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.007	▲ 0.025				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.099	▲ 0.101						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	6/16	6/17	6/18	6/21	6/22
									日銀当預残	5,274,500	5,296,000	5,308,100	5,353,500	5,367,200
									準備預金残	4,632,900	4,649,300	4,659,000	4,684,400	4,711,000
									マネタリーベース	6,482,800	6,505,500	6,518,100	6,563,900	6,578,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.034%	▲ 0.028%	▲ 0.027%	▲ 0.026%	▲ 0.029%
									コール市場残高	156,224	162,831	173,268	162,081	173,792
									うち無担	135,412	142,787	153,350	141,708	153,576
									うちO/N	80,441	87,096	94,279	81,517	92,955
									うち有担	20,812	20,044	19,918	20,373	20,216

## ●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	応募総額(億円・百万ドル)	発札総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均発札レート・利回差・価格差	抜付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/6/24			2,567	1,503	0.000		0.004	36.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/6/24			16,534	4,759	0.002		0.004	14.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/6/24			14,438	4,513	0.000		0.001	41.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/23	2021/6/24	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/23	2021/6/24	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年6月24日の予定

*月例経済報告	*英中銀MPC結果発表	*20年利付国債入札(12,000億円、6/25発行)
*5月の企業向けサービス価格指数	*米国1-3月期のGDP確報値	
	*米国5月の耐久財新規受注	

◆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