

Central Daily Market Report

2021年6月24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24日 需給速報	2021年6月25日 需給予想	2021年6月28日 当社予想			
銀行券	▲ 1,700	▲ 1,000	0			
財政	500	▲ 900	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 1,200	▲ 1,900	▲ 4,000			
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						
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		▲ 500	▲ 900			
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		▲ 200			
新型コロナ対応金融支援特別			107,800	▲ 99,700		
E T F 買入						
国債補完供給						
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	10,100	5,100	▲ 4,000			
当座預金残高	5,351,300	5,356,400	5,352,400			
準備預金残高	4,685,200					
積み終了先	4,684,900			6月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,684,900			積数	3,000	
非準備預金先	666,100			1日平均	100	
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	99.92%	日数	30.00%		

●2021年6月24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。引き続き地銀を中心に調達ニーズが強い中、レート水準に大きな変化はなく高い水準での取引が中心となった。一巡後は▲0.045~▲0.025%で散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(6/25-6/28)は、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、石油・食品等から大口の発行が見られたものの、2,800億円程度の償還総額に対して、発行は2,100億円程度にとどまり、連日の償還超となっている。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

2021/6/24	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	
	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)	為替(17時)
単位：%									0.050	0.000	28,875.23	0.34	111.01-02	110.87-89
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.081						
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.099	▲ 0.101						
6M							▲ 0.105	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.130						
日付		6/17	6/18	6/21	6/22	6/23								
日銀当預残		5,296,000	5,308,100	5,353,500	5,367,200	5,341,200								
準備預金残		4,649,300	4,659,000	4,684,400	4,711,000	4,678,000								
マネタリーベース		6,505,500	6,518,100	6,563,900	6,578,000	6,552,900								
無担O/N加重平均		▲ 0.028%	▲ 0.027%	▲ 0.026%	▲ 0.029%	▲ 0.028%								
コール市場残高		162,831	173,268	162,081	173,792	162,588								
うち無担		142,787	153,350	141,708	153,576	141,330								
うちO/N		87,096	94,279	81,517	92,955	79,239								
うち有担		20,044	19,918	20,373	20,216	21,258								

●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)
20年利付国債	176	0.50%	12,000	2021/6/25	2041/3/20	35,472.0	9,804.0	101.1500	0.4360%	31.0507%	101.2100	0.4330%	2,188.0

●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)		2021/6/24	2021/6/25	▲ 0.350	4	4		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/24	2021/6/25	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/6/25時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/6/25	2021/12/27	0	107,752	693,890

●2021年6月25日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報	*米国5月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1004回)入札(3ヶ月、60,000億円、6/28発行)
*6月の都区部消費者物価指数(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