

# Central Daily Market Report

2021年6月28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28日		2021年6月29日		2021年6月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,000		▲ 1,600	
財政	▲ 13,400		1,000		12,000	
資金過不足	▲ 13,900		0		10,400	
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			9,600			
CP等買入		▲ 500		▲ 500	5,000	
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						
国債補充供給		100				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 14,300		9,100		15,400	
当座預金残高	5,343,900		5,353,000		5,368,400	
準備預金残高	4,686,600					
積み終了先	4,686,300		6月29日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,686,300		積数		1,600	
非準備預金先	657,300		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	99.96%	日数	43.33%		

## ●2021年6月28日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態の調達姿勢にあまり変化が見られず、昨日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.045~▲0.01%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.06~▲0.01%のレンジの出会いで推移した。ターム物は7月スタートのショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(6/29-6/30)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市場は、スポットが月末にあたることから多くの発行体から調達が実施され、総額6,000億円強であった。発行レートは、玉確保のための積極的な応募により、低位横ばい圏での推移に変わりなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/6/28	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.083	0.055	0.010	29,048.02	▲ 18.16	110.80-81	110.64-65
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.083						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.095						
3M	0.005	0.070	0.024				▲ 0.103	▲ 0.101						
6M							▲ 0.106	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/21	6/22	6/23	6/24	6/25
									日銀当預残	5,353,500	5,367,200	5,341,200	5,351,300	5,358,200
									準備預金残	4,684,400	4,711,000	4,678,000	4,685,200	4,710,600
									マネタリーベース	6,563,900	6,578,000	6,552,900	6,564,700	6,572,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.026%	▲ 0.029%	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.029%
									コール市場残高	162,081	173,792	162,588	163,454	170,103
									うち無担	141,708	153,576	141,330	143,097	149,200
									うちO/N	81,517	92,955	79,239	82,206	87,764
									うち有担	20,373	20,216	21,258	20,357	20,903

## ●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	買付利率	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・利回敏感・価格敏感	全取レート・利回敏感・価格敏感	平均発札レート・利回敏感・価格敏感	抜付比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/6/29			11,232	4,505	0.003		0.004	65.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/6/29			10,161	4,506	0.006		0.007	33.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/6/29			2,382	503	0.011		0.011	59.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/28	2021/6/29	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/28	2021/6/29	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年6月29日の予定

*5月の完全失業率(市場予想：2.9%)	*米国4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(30,000億円、7/1発行)
*5月の有効求人倍率(市場予想：1.08倍)	*米国6月のCB消費者信頼感指数	
*5月の商業動態統計速報		

◆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