

Central Daily Market Report

2021年6月29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29日 需給速報	2021年6月30日 需給予想	2021年7月1日 当社予想			
銀行券	▲ 1,000	▲ 300	0			
財政	2,400	9,700	▲ 24,000			
資金過不足	1,400	9,400	▲ 24,000			
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			12,500			
国債買入	9,600					
CP等買入		▲ 500	5,000	▲ 3,000		
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						
国債補完供給	▲ 100		100			
<small>米ドル資金供給用担保資産供給</small>						
当預増減	10,400	24,000	▲ 24,000			
当座預金残高	5,354,300	5,378,300	5,354,300			
準備預金残高	4,704,300					
積み終了先	4,704,000			6月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,704,000			積数	1,300	
非準備預金先	650,000			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	46.67%		

●2021年6月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、ややレートを引き下げる先も散見されたものの、出合いの水準は昨日とほぼ横ばいとなった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.045~▲0.015%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲0.02%のレンジの出合いで推移した。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(6/30-7/1)は、▲0.095~▲0.075%程度での出合い。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>

本日は短国買入オベが前回と同額の12,500億円でおファーされ、平均落札利回較差、按分落札利回較差ともに+0.004%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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、期明けの再発行による大型案件が複数実施されたことで、発行総額6,000億円と大幅な発行超となった。発行レートは、銘柄によりばらつきがあるものの、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/6/29	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	▲ 0.029				-	▲ 0.082	0.055	0.000	28,812.61	▲ 235.41	110.60-61	110.69-70
T/N			0.000				-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.089						
3W			0.000				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.103	▲ 0.100						
6M							▲ 0.106	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/22	6/23	6/24	6/25	6/28
									日銀当預残	5,367,200	5,341,200	5,351,300	5,358,200	5,343,900
									準備預金残	4,711,000	4,678,000	4,685,200	4,710,600	4,686,600
									マネタリーベース	6,578,000	6,552,900	6,564,700	6,572,600	6,558,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.029%	▲ 0.030%
									コール市場残高	173,792	162,588	163,454	170,103	145,276
									うち無担	153,576	141,330	143,097	149,200	122,785
									うちO/N	92,955	79,239	82,206	87,764	61,779
									うち有担	20,216	21,258	20,357	20,903	22,491

●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)
2年利付国債	426	0.005%	30,000	2021/7/1	2023/7/1	105,158.0	24,504.00	100.2400	▲0.1140%	94.4616%	100.2430	▲0.1160%	5,487.0

●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
国庫短期証券買入	12,500	2021/6/30			42,489	12,501	0.004		0.004	100.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/29	2021/6/30	▲ 0.350	59	59		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/29	2021/6/30	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/7/1	2021/7/9	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2021/7/1	2021/9/24	0.340	0	0				

●2021年6月30日の予定

*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 市場予想：前月比▲2.4%	*米国6月のシカゴPM景況感指数
*5月の住宅着工統計	*ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値
*6月の消費動向調査	*英国1-3月期のGDP確報値

◆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