

Central Daily Market Report

2021年6月30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30日		2021年7月1日		2021年7月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 900		▲ 1,000	
財政	11,600		▲ 25,100		▲ 49,000	
資金過不足	11,300		▲ 26,000		▲ 50,000	
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						
CP等買入	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	▲ 1,100	100		1,100		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	24,800		▲ 24,900		▲ 50,000	
当座預金残高	5,379,100		5,354,200		5,304,200	
準備預金残高	4,709,300					
積み終了先	4,709,000		7月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,709,000		積数	900		
非準備預金先	669,800		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	99.98%	日数	50.00%		

●2021年6月30日の市場動向

◀インターバンク市場▶

本日の無担O/N物は、四半期末日に当たる影響で調達を見合わせる参加者が多く、出合い水準は昨日と比べ低下した。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.08~▲0.02%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.086~▲0.04%のレンジで散発的に出合いが見られた。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(7/1-7/2)は、▲0.085~▲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市場は、わずかな償還に対し、大型の発行が実施されたことで発行総額は1,000億円強となった。発行レートは、マイナス圏ではあるものの、銘柄によるばらつきが大きい。

●短期金融市場関連指標

2021/6/30	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.050				-	▲ 0.089	0.055	0.000	28,791.53	▲ 21.08	110.53-54	110.54-55
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.082						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.008	▲ 0.019				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.025	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.103	▲ 0.100						
6M							▲ 0.106	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	6/23	6/24	6/25	6/28	6/29
									日銀当預残	5,341,200	5,351,300	5,358,200	5,343,900	5,354,300
									準備預金残	4,678,000	4,685,200	4,710,600	4,686,600	4,704,300
									マネタリーベース	6,552,900	6,564,700	6,572,600	6,558,800	6,570,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.029%	▲ 0.030%	▲ 0.029%
									コール市場残高	162,588	163,454	170,103	145,276	150,362
									うち無担	141,330	143,097	149,200	122,785	129,690
									うちO/N	79,239	82,206	87,764	61,779	70,094
									うち有担	21,258	20,357	20,903	22,491	20,672

●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)		2021/6/30	2021/7/1	▲ 0.350	1059	1059		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/30	2021/7/1	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月1日の予定

*6月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI) +15	*米国5月の建設支出 *米国6月のISM製造業景況指数	*10年利付国債入札 (26,000億円、7/2発行)
---	--------------------------------	--------------------------------

◆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