

Central Daily Market Report

2021年6月3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3日 需給速報	2021年6月4日 需給予想	2021年6月7日 当社予想
銀行券	▲ 100	500	0
財政	300	▲ 21,400	1,000
資金過不足	200	▲ 20,900	1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
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	11,700		
CP等買入		▲ 100	▲ 100
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	▲ 200
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 200	300	200
※ドル資金供給用担保準備供給			
当預増減	11,800	▲ 21,000	1,000
当座預金残高	5,205,000	5,184,000	5,185,000
準備預金残高	4,577,500		
積み終了先	4,577,500		
超過準備	4,577,400		
非準備預金先	627,500		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額		3,743,300	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			61.29%

●2021年6月3日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、地銀業態を中心に▲0.065~▲0.02%の出会いで始まった。レートは前日まで低下基調であったが、運用サイドの資金放出ニーズがやや減退したことで下げ止まりを見せた。ターム物は出会いなく閑散だった。

＜レポ市場＞

GC T/N(6/4-6/7)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2Y410~424、5Y140~147、10Y345~362、20Y170~176、30Y59~70、40Y10~13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＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は発行・償還共に800億円程度であった。一部の鉄鋼業態において大型発行が見られたものの、案件は少なく比較的落ち着いたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/6/3	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.083	0.080	0.005	29,058.11	111.97	109.58-59	109.83-84
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.108	▲ 0.105						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/27	5/28	5/31	6/1	6/2
									日銀当預残	5,285,000	5,292,700	5,299,700	5,251,000	5,193,200
									準備預金残	4,611,700	4,618,400	4,626,800	4,599,400	4,557,100
									マネタリーベース	6,495,500	6,503,400	6,509,700	6,460,600	6,402,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.025%	▲ 0.034%	▲ 0.038%	▲ 0.043%
									コール市場残高	163,114	164,727	154,383	163,121	151,064
									うち無担	141,534	142,763	134,658	140,661	130,922
									うちO/N	79,836	83,605	79,700	85,748	75,859
									うち有担	21,580	21,964	19,725	22,460	20,142

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	362	0.10%	26,000	2021/6/4	2031/3/20	63,781.0	21,680.00	100.1500	0.0840%	29.5378%	100.2100	0.0780%	4,298.0	14.01

●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)		2021/6/3	2021/6/4	▲ 0.350	216	216		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/3	2021/6/4	▲ 0.350	0	0				

●2021年6月4日の予定

*4月の全世帯家計調査 市場予想：消費支出、前年比+9.3%	*米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国5月の雇用統計	*国庫短期証券(998回)入札 (3ヶ月、63,000億円、6/7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