

Central Daily Market Report

2021年6月10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10日		2021年6月11日		2021年6月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		200		1,000	
財政	▲ 6,300		▲ 2,300		2,000	
資金過不足	▲ 6,700		▲ 2,100		3,000	
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	14,600					
CP等買入		▲ 300		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			600	▲ 500		
社債等買入	1,300					
新型コロナ対応金融支援特別				▲ 200		
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保準備供給						
当預増減	8,700		▲ 2,900		3,000	
当座預金残高	5,201,100		5,198,200		5,201,200	
準備預金残高	4,585,000					
積み終了先	4,585,000				6月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,585,000				積数	0
非準備預金先	616,100				1日平均	0
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						3,750,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	83.87%		

●2021年6月10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▲0.04~▲0.01%での調達で始まった。引き続き着地に向けた調達ニーズは強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(6/11-6/14)は、▲0.08~▲0.065%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2Y410~424、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＞

本日の短国市場は動意なく閑散な中、6M物が▲0.107%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は食料品業態においてまとまった発行が実施された。償還総額300億円程度に対して、発行総額は450億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/6/10	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.064	0.045	▲ 0.020	28,958.56	97.76	109.61-62	109.54-56
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.012				-	▲ 0.075						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.087						
1M	0.013	0.100	0.046				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.104	▲ 0.101						
6M							▲ 0.106	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.133						
									日付	6/3	6/4	6/7	6/8	6/9
									日銀当預残	5,205,000	5,183,200	5,182,600	5,189,700	5,192,400
									準備預金残	4,577,500	4,575,800	4,570,700	4,588,100	4,585,600
									マネタリーベース	6,414,400	6,392,100	6,390,800	6,397,400	6,400,000
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.034%	▲0.032%	▲0.029%	▲0.026%
									コール市場残高	143,088	152,480	134,458	141,070	135,339
									うち無担	123,979	131,800	114,013	121,665	115,406
									うちO/N	69,028	76,519	59,470	65,702	60,043
									うち有担	19,109	20,680	20,445	19,405	19,933

●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)
流動性供給	335	-	5,000	2021/6/11		22,019.0	4,977.0		▲0.016%	21.7695%		▲0.017%	
エネルギー対策	-	-	8,000	2021/6/21	2022/6/20	220,567.0	7,999.97		0.0000%	3.6271%		0.0000%	

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/10	2021/6/11	▲ 0.350	157	157		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/10	2021/6/11	▲ 0.350	0	0				

●2021年6月11日の予定

*4-6月期の法人企業景気予測調査季報	*6月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1000回)入札(3ヶ月、60,000億円、6/14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