

Central Daily Market Report

2021年6月25日(金)

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25日		2021年6月28日		2021年6月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 400		▲ 1,000	
財政	1,000		▲ 9,600		4,000	
資金過不足	0		▲ 10,000		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						
CP等買入		▲ 900		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
新型コロナ対応金融支援特別	107,800	▲ 99,700				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	6,900		▲ 10,400		3,000	
当座預金残高	5,358,200		5,347,800		5,350,800	
準備預金残高	4,710,600					
積み終了先	4,710,200		6月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,710,200		積数		2,000	
非準備預金先	647,600		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	99.94%	日数	40.00%		

●2021年6月25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▲0.045~▲0.01%での調達で始まった。週末3日積みにあたるものの、前日比でレート水準はほぼ横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.05%近辺で調整の出合いが見られる程度で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(6/28-6/29)は、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。SCはローラー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TB3M物(1004回)の入札が実施され、WI取引において▲0.098%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0982%、按分落札利回▲0.0962%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.103~▲0.100%の出合いが見られるなど、堅調に推移した。この他に、1Y物が▲0.117%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、4,700億円程度の償還総額に対して、2,100億円程度の発行総額となり、引き続き償還超となっている。機械・石油等からは大型発行も実施された。発行レートに特段の変化は見られていない。また、CP等買入オペが事前予定通り5,000億円でオファーされた。結果は、按分落札レート▲0.010%、平均落札レート▲0.004%と前回比で按分落札レートは若干低下したものの、平均落札レートは横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2021/6/25	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.084	0.045	▲ 0.005	29,066.18	190.95	110.92-93	110.75-76
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.103	▲ 0.101						
6M							▲ 0.106	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
日付	6/18	6/21	6/22	6/23	6/24									
日銀当預残	5,308,100	5,353,500	5,367,200	5,341,200	5,351,300									
準備預金残	4,659,000	4,684,400	4,711,000	4,678,000	4,685,200									
マネタリーベース	6,518,100	6,563,900	6,578,000	6,552,900	6,564,700									
無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.026%	▲0.029%	▲0.028%	▲0.028%									
コール市場残高	173,268	162,081	173,792	162,588	163,454									
うち無担	153,350	141,708	153,576	141,330	143,097									
うちO/N	94,279	81,517	92,955	79,239	82,206									
うち有担	19,918	20,373	20,216	21,258	20,357									

●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)
国庫短期証券	1004	-	60,000	2021/6/28	2021/9/27	182,884.3	49,023.9	100.0240	▲0.0962%	54.3982%	100.0245	▲0.0982%	10,975.0

●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
CP等買入	5,000	2021/6/30			6,873	4,974	▲0.010		▲0.004	93.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/6/25	2021/6/28	▲0.350	93	93		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/6/25	2021/6/28	▲0.350	0	0				

●2021年6月28日の予定

*決定会合における主な意見(6月17・18日分)

◆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