

# Central Daily Market Report

2021年4月1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4月1日		2021年4月2日		2021年4月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		200		2,000	
財政	▲ 34,900		▲ 33,900		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 35,800		▲ 33,700		▲ 4,000	
<b>金融調節</b>						
	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	5,200					
CP等買入		▲ 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						
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	5,900		1,100		
※ドル資金供給用担保準備供給						
当預増減	▲ 25,900		▲ 32,600		▲ 4,000	
当座預金残高	5,199,800		5,167,200		5,163,200	
準備預金残高	4,585,800					
積み終了先	4,585,800		4月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,585,800		積数	200		
非準備預金先	614,000		1日平均	0		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,631,700	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	54.84%		

## ●2021年4月1日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.020~▲0.003%の調達で始まった。期末要因が剥落したことで、調達を再開する動きが見られ、レートは大幅に上昇した。一巡後は▲0.050~▲0.015%近辺の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、新年度に入ったことで、1~2W物の出合いが複数見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(4/2-4/5)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2Y410~422、5Y140~146、10Y345~361、20Y170~175、30Y59~69、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、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額は400億円程度に対し、発行総額は1,100億円程度であった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/4/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.088	0.120	0.030	29,388.87	210.07	110.75-76	110.68-69
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.013	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.102						
3M			0.130				▲ 0.100	▲ 0.104						
6M			0.150				▲ 0.113	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.138						
									日付	3/25	3/26	3/29	3/30	3/31
									日銀当預残	5,108,900	5,111,500	5,149,200	5,188,300	5,225,700
									準備預金残	4,506,900	4,509,800	4,555,000	4,606,000	4,633,900
									マネタリーベース	6,319,000	6,322,300	6,360,600	6,399,100	6,436,100
									無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.044%
									コール市場残高	156,004	178,484	165,206	151,586	97,090
									うち無担	129,336	151,566	138,028	130,110	83,339
									うちO/N	72,973	93,428	77,360	72,492	55,796
									うち有担	26,668	26,918	27,178	21,476	13,751

## ●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)
10年利付国債	362	0.10%	26,000	2021/4/2	2031/3/20	74,424.0	21,005.0	99.7600	0.1240%	82.7380%	99.7700	0.1230%	4,964.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/4/9	2021/10/8	305,655.0	11,000.48		0.0000%	3.5990%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/1	2021/4/2	▲ 0.350	1,047	1,047		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/1	2021/4/2	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2021年4月2日の予定

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み *3月のマネタリーベース	*米国3月の雇用統計 *EURO、London祝日(Good Friday)	*国庫短期証券(984回)入札 (3ヶ月、67,000億円、4/5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