

Central Daily Market Report

2021年4月2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4月2日 需給速報	2021年4月5日 需給予想	2021年4月6日 当社予想
銀行券	300	600	2,000
財政	▲ 33,900	▲ 8,000	3,000
資金過不足	▲ 33,600	▲ 7,400	5,000
金融調節			
	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			
CP等買入			
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	▲ 300	1,100	300
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 32,800	▲ 7,100	5,000
当座預金残高	5,167,000	5,159,900	5,164,900
準備預金残高	4,555,000		
積み終了先	4,555,000		4月5日以降の残り所要積立額
超過準備	4,555,000		積数
非準備預金先	612,000		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	100.00%	日数
			64.52%

●2021年4月2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▲0.010~▲0.002%の調達で始まった。週末要因により取り上がる動きが見られ、レートは上昇した。一巡後は▲0.080~▲0.010%近辺の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は月内物の出会いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/N(4/5-4/6)は、▲0.085~▲0.07%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2Y410~422、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>

本日はTB3M物(984回)の入札が実施され、WI取引において、▲0.098~▲0.094%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.0930%、按分落札利回▲0.0893%と、やや低調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.091~▲0.087%出会いと、軟調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は200億円程度に対し、発行総額は2,200億円程度であった。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

2021/4/2	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.081	0.115	▲ 0.005	29,854.00	465.13	110.61-62	110.54-56
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.015	▲ 0.002	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
3W			0.150				-	▲ 0.092						
1M	0.001	0.250	0.120				-	▲ 0.097						
3M			0.005				▲ 0.090	▲ 0.103						
6M							▲ 0.108	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.138						
									日付	3/26	3/29	3/30	3/31	4/1
									日銀当預残	5,111,500	5,149,200	5,188,300	5,225,700	5,199,800
									準備預金残	4,509,800	4,555,000	4,606,000	4,633,900	4,585,500
									マネタリーベース	6,322,300	6,360,600	6,399,100	6,436,100	6,411,000
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.044%	▲0.014%
									コール市場残高	178,484	165,206	151,586	97,090	152,186
									うち無担	151,566	138,028	130,110	83,339	129,702
									うちO/N	93,428	77,360	72,492	55,796	88,919
									うち有担	26,918	27,178	21,476	13,751	22,484

●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	984	-	67,000	2021/4/5	2021/7/12	168,732.0	54,619.4	100.0240	▲0.0893%	47.1065%	100.0250	▲0.0930%	12,380.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/2	2021/4/5	▲0.350	308	308		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/2	2021/4/5	▲0.350	0	0				

●2021年4月5日の予定

*4月の日銀当座預金増減要因見込み

*EURO、London祝日(Easter Monday)

*米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫

*米国3月のISM非製造業景況指数

◆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