

# Central Daily Market Report

2021年4月5日(月)

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5日		2021年4月6日		2021年4月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		800		1,000	
財政	▲ 10,700		1,800		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 10,100		2,600		▲ 6,000	
<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						▲ 4,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,900			
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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入			500			
国債補完供給	▲ 400	300		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 10,200		14,300		▲ 10,900	
当座預金残高	5,156,800		5,171,100		5,160,200	
準備預金残高	4,572,100					
積み終了先	4,572,100		4月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,572,000		積数		100	
非準備預金先	584,700		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	67.74%		

## ●2021年4月5日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、先週に引き続き高い水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.015~▲0.003%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.05~▲0.005%のレンジの出合いで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(4/6-4/7)は、▲0.080~▲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2Y414~422、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、3M物が▲0.087%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額100億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度となった。商社の大口発行が発行総額を押し上げたが、案件は少なかった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/4/5	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.063	0.115	0.000	30,089.25	235.25	110.68-69	110.63-64
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.078						
2W			0.030				-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.085						
1M	▲ 0.004	0.100	0.008				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.089	▲ 0.099						
6M							▲ 0.108	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	3/29	3/30	3/31	4/1	4/2
									日銀当預残	5,149,200	5,188,300	5,225,700	5,199,800	5,167,000
									準備預金残	4,555,000	4,606,000	4,633,900	4,585,500	4,555,000
									マネタリーベース	6,360,600	6,399,100	6,436,100	6,411,000	6,378,000
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.044%	▲0.014%	▲0.012%
									コール市場残高	165,206	151,586	97,090	152,186	157,457
									うち無担	138,028	130,110	83,339	129,702	134,690
									うちO/N	77,360	72,492	55,796	88,919	90,092
									うち有担	27,178	21,476	13,751	22,484	22,767

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均貸付レート・利回差・価格差	貸付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/4/6			3,912	1,503	0.005		0.008	1.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/4/6			11,490	4,755	0.000		0.002	37.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/4/6			14,216	4,504	0.002		0.003	99.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/5	2021/4/6	▲ 0.350	424	424		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/5	2021/4/6	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年4月6日の予定

*2月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲5.3%)	*30年利付国債入札(9,000億円、4/7発行)
*2月の毎月勤労統計調査速報	*交付税特別会計借入(11,000億円、4/16借入)

◆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