

Central Daily Market Report

2021年4月6日(火)

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6日 需給速報	2021年4月7日 需給予想	2021年4月8日 当社予想			
銀行券	900	200	1,000			
財政	8,400	▲ 7,900	0			
資金過不足	9,300	▲ 7,700	1,000			
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			1,700	▲ 4,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			20,000			
国債買入	10,900					
CP等買入		▲ 100		▲ 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	500		400			
国債補完供給	▲ 200	400		200		
米ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	20,800		9,600			1,000
当座預金残高	5,177,600		5,187,200			5,188,200
準備預金残高	4,551,700					
積み終了先	4,551,700				4月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,551,700				積数	100
非準備預金先	625,900				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	70.97%		

●2021年4月6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(4/7-4/8)は、▲0.085~▲0.070%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、短国買入オペアが前回より5,000億円増額の20,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.005%と、やや弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、6M物が▲0.100%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還額が少なかったこともあり、商社から発行が見られた程度であった。案件が少なく、非常に閑散としたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2021/4/6	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.074	0.105	▲ 0.010	29,696.63	▲ 392.62	110.19-20	110.30-31
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.083						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.009				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.008	0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.088						
1M	▲ 0.007	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.087	▲ 0.101						
6M							▲ 0.100	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	3/30	3/31	4/1	4/2	4/5
									日銀当預残	5,188,300	5,225,700	5,199,800	5,167,000	5,156,800
									準備預金残	4,606,000	4,633,900	4,585,500	4,555,000	4,571,100
									マネタリーベース	6,399,100	6,436,100	6,411,000	6,378,000	6,367,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.044%	▲ 0.014%	▲ 0.012%	▲ 0.010%
									コール市場残高	151,586	97,090	152,186	157,457	136,570
									うち無担	130,110	83,339	129,702	134,690	115,207
									うちO/N	72,492	55,796	88,919	90,092	68,314
									うち有担	21,476	13,751	22,484	22,767	21,363

●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)
30年利付国債	70	0.70%	9,000	2021/4/7	2051/3/20	22,851.0	7,354.0	100.2000	0.6910%	66.6415%	100.2800	0.6880%	1,637.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/4/16	2021/10/15	322,792.0	11,000.12		0.0000%	3.4079%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2021/4/7	2021/4/21		1,701	1,701				
国庫短期証券買入	20,000	2021/4/7			63,731	20,007	0.005		0.006	38.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/6	2021/4/7	▲ 0.350	240	240		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/6	2021/4/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/8	2021/4/15	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/8	2021/7/1	0.320	0	0				

●2021年4月7日の予定

*2月の景気動向指数速報	*米国2月の貿易収支
*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国2月の消費者信用残高

◆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