

Central Daily Market Report

2021年4月8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8日		2021年4月9日		2021年4月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		700		2,000	
財政	2,900		▲ 24,900		▲ 7,000	
資金過不足	2,800		▲ 24,200		▲ 5,000	
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	7,600					
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					1,300	
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	200					
国債補充供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	10,500		▲ 24,400		▲ 3,700	
当座預金残高	5,199,000		5,174,600		5,170,900	
準備預金残高	4,596,400					
積み終了先	4,596,400				4月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,596,400				積数	100
非準備預金先	602,600				1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						3,646,500
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	77.42%		

●2021年4月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、参加者の調達姿勢にほとんど変化が見られず、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▲0.011~▲0.003%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.045~▲0.005%のレンジの出会いで推移した。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(4/9-4/12)は、▲0.090~▲0.070%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>

本日はTB6M物(985回)の入札が実施された。WI取引において出会いは見られなかったものの、平均落札利回▲0.0962%、按分落札利回▲0.0962%と軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.110%の出会いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.092~▲0.089%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還額も小規模であり、小口の案件が実施された程度で非常に閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2021/4/8	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.077	0.095	0.000	29,708.98	▲ 21.81	109.85-87	109.50-51
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.080						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W			▲ 0.008				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.003	0.050	0.026				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.087						
1M			0.030				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.094	▲ 0.100						
6M							▲ 0.110	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136						
									日付	4/1	4/2	4/5	4/6	4/7
									日銀当預残	5,199,800	5,167,000	5,156,800	5,177,600	5,188,500
									準備預金残	4,585,500	4,555,000	4,571,100	4,551,000	4,586,100
									マネタリーベース	6,411,000	6,378,000	6,367,300	6,387,200	6,397,900
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.012%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%
									コール市場残高	152,186	157,457	136,570	138,409	150,082
									うち無担	129,702	134,690	115,207	117,680	128,708
									うちO/N	88,919	90,092	68,314	71,442	79,655
									うち有担	22,484	22,767	21,363	20,729	21,374

●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	985	-	34,000	2021/4/12	2021/10/11	137,501.0	27,716.30	100.0480	▲0.0962%	61.0235%	100.0480	▲0.0962%	6,283.0
5年利付国債	147	0.005%	25,000	2021/4/9	2026/3/20	91,914.0	20,213.0	100.4600	▲0.0870%	77.7054%	100.4800	▲0.0910%	4,779.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/8	2021/4/9	▲0.350	58	58		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/8	2021/4/9	▲0.350	0	0				

●2021年4月9日の予定

*2月の米卸売売上高	*国庫短期証券(986回)入札 (3ヶ月、65,000億円、4/12発行)
*3月の米生産者物価指数	*エネルギー対策借入 (8,000億円、4/20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