

# Central Daily Market Report

2021年4月12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12日		2021年4月13日		2021年4月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		600		0	
財政	▲ 7,000		2,900		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 6,400		3,500		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
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			▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	200					
国債補完供給		500				
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当増減	▲ 4,500		3,000		▲ 6,000	
当座預金残高	5,169,800		5,172,800		5,166,800	
準備預金残高	4,548,000					
積み終了先	4,548,000		4月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,548,000		積数		0	
非準備預金先	621,800		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	90.32%		

## ●2021年4月12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▲0.015～▲0.002%の出合いで始まった。引き続き地銀業態を中心に調達ニーズが強いため、高めのレート推移となっている。一方で積み最終日が近づいており、調達に目途が付き始めた先も出てきている。ターム物はオファーが少ない中、ロール案件を中心に引き合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(4/13-4/14)は、▲0.100～▲0.080%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、6M物が▲0.118%、1Y物が▲0.131%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP市場は、入札件数・金額共に少なく総額350億円となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/4/12	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	
	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)
単位：%							売買参考値	平均値	0.105	0.005	29,538.73	▲ 229.33	109.72-73	109.45-46
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.081						
T/N	▲ 0.007	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.008	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.003	0.045	0.015				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.100	▲ 0.099						
6M							▲ 0.115	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
日付		4/5	4/6	4/7	4/8	4/9								
日銀当預残	5,156,800	5,177,600	5,188,500	5,199,000	5,174,300									
準備預金残	4,571,100	4,551,000	4,586,100	4,596,200	4,584,400									
マネタリーベース	6,367,300	6,387,200	6,397,900	6,408,500	6,383,100									
無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%									
コール市場残高	136,570	138,409	150,082	147,880	138,382									
うち無担	115,207	117,680	128,708	127,418	118,393									
うちO/N	68,314	71,442	79,655	77,890	69,585									
うち有担	21,363	20,729	21,374	20,462	19,989									

## ●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	棄分率	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)	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)		2021/4/12	2021/4/13	▲ 0.350	28	28		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/12	2021/4/13	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年4月13日の予定

*3月のマネーストック	*米国3月の消費者物価指数	*流動性供給入札(5,000億円、4/14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