

Central Daily Market Report

2021年4月13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13日		2021年4月14日		2021年4月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700	▲ 200			▲ 1,000	
財政	1,000	▲ 5,800			78,000	
資金過不足	1,700	▲ 6,000			77,000	
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			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200			200		
<small>※ドル資金供給用担保国債供給</small>						
当増減	1,000		4,000		77,000	
当座預金残高	5,170,800		5,174,800		5,251,800	
準備預金残高	4,544,800					
積み終了先	4,544,800			4月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,544,800			積数	0	
非準備預金先	626,000			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	93.55%		

●2021年4月13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▲0.025~▲0.001%の出合いが始まった。積み最終日が間近となり、調達姿勢に差が生じている。引き続き▲0.01~▲0.001%程度の積極的な調達が見られている一方で、積みの進捗が進んでいる先では、▲0.025~▲0.02%程度の調整の出合いが見られた。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>

GCT/N(4/14-4/15)は、▲0.115~▲0.090%程度での出合い。SCI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1兆円減額の10,000億円でおアファーされ、平均落札利回り較差+0.004%、按分落札利回り較差+0.003%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、償還500億円に対して、入札は大型案件こそなかったものの、複数の事業会社から実施されて約1,000億円と発行超であった。発行レートは概ね横ばい。本日のCP買入オペアは、事前予定通り4,000億円がおアファーされた。結果は、平均落札レート▲0.021%、按分レート▲0.029%といずれも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2021/4/13	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	
	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	▲ 0.013				-	▲ 0.099	0.100	▲ 0.005	29,751.61	212.88	109.38-39	109.31-33
T/N	▲ 0.010	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.111						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W							-	▲ 0.095						
2W							-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.009	▲ 0.003	▲ 0.007				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.100	▲ 0.101						
6M							▲ 0.114	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136						
									日付	4/6	4/7	4/8	4/9	4/12
									日銀当預残	5,177,600	5,188,500	5,199,000	5,174,300	5,169,800
									準備預金残	4,551,000	4,586,100	4,596,200	4,584,400	4,548,000
									マネタリーベース	6,387,200	6,397,900	6,408,500	6,383,100	6,378,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.012%
									コール市場残高	138,409	150,082	147,880	138,382	138,031
									うち無担	117,680	128,708	127,418	118,393	119,053
									うちO/N	71,442	79,655	77,890	69,585	69,435
									うち有担	20,729	21,374	20,462	19,989	18,978

●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)
流動性供給	331	-	5,000	2021/4/14		15,450.0	4,978.0		▲0.0070%	46.6121%		▲0.0080%	

●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
国庫短期証券買入	10,000	2021/4/14			31,884	10,004	0.003		0.004	91.9
CP等買入	4,000	2021/4/16			8,189	4,000	▲0.029		▲0.021	33.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/13	2021/4/14	▲ 0.350	176	176		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/13	2021/4/14	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/15	2021/4/22	0.310	1	1				
米ドル資金供給		2021/4/15	2021/7/9	0.330	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2021/4/14	2021/4/23		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2021年4月14日の予定

*黒田日銀総裁、第96回信託大会において講演	*米国ページブック	*交付税特別会計借入(11,000億円、4/23借入)
*2月の機械受注統計(市場予想：電力除く民需、前月比+2.8%)		

◆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