

Central Daily Market Report

2021年4月14日(水)
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14日		2021年4月15日		2021年4月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 5,000		78,300		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 5,100		77,400		▲ 2,000	
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			14,000			
CP等買入		▲ 200		▲ 100	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					1,300	▲ 1,300
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	200		400		
<small>※ドル資金供給用担保確保供給</small>						
当預増減	4,500		91,700		2,000	
当座預金残高	5,175,300		5,267,000		5,269,000	
準備預金残高	4,556,200					
積み終了先	4,556,200			4月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,556,100			積数	0	
非準備預金先	619,100			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	96.77%		

●2021年4月14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~▲0.002%の出会いで始まった。着地にむけた調整から調達姿勢に差が生じている。引き続き▲0.01~▲0.002%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%程度のお合いが見られた。ターム物はオファーが少ない中、新積み期スタートの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(4/15-4/16)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。SCはローラー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、特段のお合いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、償還600億円強に対して、入札は少額の発行が大半となり、発行は総額550億円程度とわずかに償還超となった。発行レートは、引き続き低位横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2021/4/14	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.086	0.085	▲ 0.015	29,620.99	▲ 130.62	108.92-93	108.99-01
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.007	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.010				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.100	▲ 0.101						
6M							▲ 0.114	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136						
									日付	4/7	4/8	4/9	4/12	4/13
									日銀当預残	5,188,500	5,199,000	5,174,300	5,169,800	5,170,800
									準備預金残	4,586,100	4,596,200	4,584,400	4,548,000	4,544,800
									マネタリーベース	6,397,900	6,408,500	6,383,100	6,378,000	6,378,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.012%	▲ 0.013%
									コール市場残高	150,082	147,880	138,382	138,031	135,084
									うち無担	128,708	127,418	118,393	119,053	115,076
									うちO/N	79,655	77,890	69,585	69,435	65,423
									うち有担	21,374	20,462	19,989	18,978	20,008

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	11,000	2021/4/23	2021/10/22	411,979.0	11,000.14		0.0000%	2.6701%		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	応募総額(億円・百万ドル)	預り総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均預りレート・利回差・価格差	抜付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/4/15			15,309	4,756	▲ 0.002		▲ 0.002	89.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/4/15			14,887	4,507	▲ 0.007		▲ 0.004	2.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/4/15			11,444	4,510	▲ 0.014		▲ 0.013	77.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/14	2021/4/15	▲ 0.350	182	182		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/14	2021/4/15	▲ 0.350	197	197		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第10回	2021/4/16	2023/2/17	0	1,268

●2021年4月15日の予定

*米国2月の企業在庫
*米国3月の小売売上高
*米国3月の鉱工業生産・設備稼働率

*流動性供給入札
(5,000億円、4/16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