

Central Daily Market Report

2021年4月15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15日 需給速報	2021年4月16日 需給予想	2021年4月19日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 100	0			
財政	77,300	▲ 400	7,000			
資金過不足	76,400	▲ 500	7,000			
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	14,000					
CP等買入		▲ 100	4,000	▲ 400		
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	▲ 600	400		600		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	90,100		3,700			7,000
当座預金残高	5,265,400		5,269,100			5,276,100
準備預金残高	4,629,900					
積み終了先	4,629,900				4月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,629,900				積数	3,599,500
非準備預金先	635,500				1日平均	120,000
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						3,599,500
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2021年4月15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~▲0.001%の出合いが始まった。積み最終日で着地に向けた調整から、一部の先で取り上がる動きが見られた。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(4/16-4/19)は、▲0.105~▲0.085%程度での出合い。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、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP市場は、償還300億円弱に対して、入札は550億円と発行超であった。発行レートは銘柄によりまちまちであるものの、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/4/15	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	▲ 0.055	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.082	0.085	0.000	29,642.69	21.70	108.89-90	108.81-83
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.089						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.009	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.010	0.200	0.010				-	▲ 0.091						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.015	0.200	0.076				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.100	▲ 0.101						
6M							▲ 0.114	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136						
									日付	4/8	4/9	4/12	4/13	4/14
									日銀当預残	5,199,000	5,174,300	5,169,800	5,170,800	5,175,300
									準備預金残	4,596,200	4,584,400	4,548,000	4,544,800	4,556,200
									マネタリーベース	6,408,500	6,383,100	6,378,000	6,378,300	6,383,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.012%	▲ 0.013%	▲ 0.013%
									コール市場残高	147,880	138,382	138,031	135,084	142,389
									うち無担	127,418	118,393	119,053	115,076	121,789
									うちO/N	77,890	69,585	69,435	65,423	73,996
									うち有担	20,462	19,989	18,978	20,008	20,600

●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	332	-	5,000	2021/4/16		23,359.0	4,967.0		▲0.0030%	47.1379%		▲0.0040%	

●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)		2021/4/15	2021/4/16	▲ 0.350	535	535		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/15	2021/4/16	▲ 0.350	42	42		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年4月16日の予定

*2月の石油等消費動態統計	*米国3月の住宅着工件数	*国庫短期証券(987回)入札(3ヶ月、65,000億円、4/19発行)
	*米国4月のミンガン大消費者信頼感指数速報	
	*ユーロ圏3月の消費者物価指数改定値	

◆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