

# Central Daily Market Report

2021年4月16日(金)

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16日		2021年4月19日		2021年4月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 600		▲ 1,000	
財政	2,300		8,200		▲ 26,000	
資金過不足	2,300		7,600		▲ 27,000	
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						
CP等買入	4,000	▲ 400		▲ 100		
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	▲ 200	600		200		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	6,300		7,700		▲ 27,000	
当座預金残高	5,271,700		5,279,400		5,252,400	
準備預金残高	4,621,000					
積み終了先	4,618,700		4月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,424,200		積数		9,100	
非準備預金先	650,700		1日平均		300	
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	99.75%	日数	10.00%		

## ●2021年4月16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。今積み期はマクロ加算残高にかかる基準比率が5%増加したこと(15.5%→20.5%)、日銀の点検による新施策の算定が一部開始されたこと、大型連休の前倒し調達等の要因から、積み初日としては高めのレート水準となった。ターム物はショートターム物で引き合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(4/19-4/20)は、▲0.105~▲0.09%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＞

本日はTB3M物(987回)の入札が実施された。WI取引においては▲0.098~▲0.097%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0990%、按分落札利回▲0.0968%と無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.105%出合いと、しっかりとした推移となった。

### ＜CP市場＞

CP市場は、償還が約800億円に対して、入札は複数業態から実施され合計1,500億円と発行超であった。発行レートは概ね横ばいながらも、銘柄によるバラツキが大きく見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2021/4/16	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.098	0.085	0.000	29,683.37	40.68	108.68-69	108.89-90	
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.095							
S/N			▲ 0.009				-	-							
1W	▲ 0.009	▲ 0.004	▲ 0.007				-	▲ 0.093							
2W	▲ 0.008	▲ 0.004	▲ 0.005				-	▲ 0.096							
3W	▲ 0.007	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.098							
1M	▲ 0.007	▲ 0.004	▲ 0.006				-	▲ 0.102							
3M							▲ 0.103	▲ 0.104							
6M							▲ 0.114	▲ 0.115							
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136							
									日付		4/9	4/12	4/13	4/14	4/15
									日銀当預残	5,174,300	5,169,800	5,170,800	5,175,300	5,265,400	
									準備預金残	4,584,400	4,548,000	4,544,800	4,556,200	4,629,900	
									マネタリーベース	6,383,100	6,378,000	6,378,300	6,383,000	6,474,000	
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.012%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.010%	
									コール市場残高	138,382	138,031	135,084	142,389	134,047	
									うち無担	118,393	119,053	115,076	121,789	113,386	
									うちO/N	69,585	69,435	65,423	73,996	68,803	
									うち有担	19,989	18,978	20,008	20,600	20,661	

## ●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	987	-	65,000	2021/4/19	2021/7/26	218,997.0	52,982.0	100.0260	▲0.0968%	23.4893%	100.0266	▲0.0990%	12,017.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/16	2021/4/19	▲ 0.350	200	200		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/16	2021/4/19	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年4月19日の予定

\*3月の貿易統計

\*国庫短期証券(988回)入札  
(1年、35,000億円、4/20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