

Central Daily Market Report

2021年4月19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19日		2021年4月20日		2021年4月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 400		▲ 2,000	
財政	3,400		▲ 22,800		▲ 9,000	
資金過不足	2,700		▲ 23,200		▲ 11,000	
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						▲ 1,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,000			
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 1,500	200		1,500		
※ドル資金供給用担保提供						
当増減	1,300		▲ 16,700		▲ 12,700	
当座預金残高	5,273,000		5,256,300		5,243,600	
準備預金残高	4,627,800					
積み終了先	4,626,300		4月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,625,600		積数	6,900		
非準備預金先	645,200		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	99.81%	日数	13.33%		

●2021年4月19日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.020~▲0.002%の出会いで始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(4/20-4/21)は、▲0.10~▲0.09%程度での出会い。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TB1Y(988回)の入札が実施された。WI取引においては▲0.125~▲0.123%の出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1268%、按分落札利回▲0.1258%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▲0.130%出会いと、堅調な推移となった。

＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は発行・償還共に300億円程度であった。小型案件のみの閑散としたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/4/19	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				-	▲ 0.089	0.080	▲ 0.005	29,685.37	2.00	108.72-73	108.21-23
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.008	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.010	▲ 0.004	▲ 0.007				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.101						
1M	▲ 0.007	0.150	0.044				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.103	▲ 0.106						
6M							▲ 0.114	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	4/12	4/13	4/14	4/15	4/16
									日銀当預残	5,169,800	5,170,800	5,175,300	5,265,400	5,271,700
									準備預金残	4,548,000	4,544,800	4,556,200	4,629,900	4,621,000
									マネタリーベース	6,378,000	6,378,300	6,383,000	6,474,000	6,480,300
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.010%	▲0.014%
									コール市場残高	138,031	135,084	142,389	134,047	159,256
									うち無担	119,053	115,076	121,789	113,386	139,901
									うちO/N	69,435	65,423	73,996	68,803	89,233
									うち有担	18,978	20,008	20,600	20,661	19,355

●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	988	-	35,000	2021/4/20	2022/4/20	106,320.0	28,606.6	100.1260	▲0.1258%	80.1260%	100.1270	▲0.1268%	6,393.0

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/4/20			18,541	4,502	0.003		0.003	91.3
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/4/20			2,161	502	0.003		0.004	90.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/19	2021/4/20	▲ 0.350	1,510	1,510		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/19	2021/4/20	▲ 0.350	0	0				

●2021年4月20日の予定

*2月の第3次産業活動指数	*20年利付国債入札(12,000億円、4/21発行)	*交付税特別会計借入(11,000億円、5/7借入)
---------------	-----------------------------	----------------------------

◆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