

Central Daily Market Report

2021年4月20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20日 需給速報	2021年4月21日 需給予想	2021年4月22日 当社予想
銀行券	▲ 400	▲ 1,300	▲ 3,000
財政	▲ 22,100	▲ 9,400	3,000
資金過不足	▲ 22,500	▲ 10,700	0

●2021年4月20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～▲0.003%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(4/21-4/22)は、▲0.11～▲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2Y414～423、5Y140～147、10Y345～362、20Y170～176、30Y59～70、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、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額300億円程度に対して、発行総額は3,000億円程度と大きく発行超であった。電力・陸運業態において大型発行が見られ、比較的活況な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。

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			3,400	▲ 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				▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			300			
国債補完供給	▲ 100	1,500		100		
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	▲ 16,100		▲ 8,800			0

当座預金残高	5,256,900	5,248,100	5,248,100
準備預金残高	4,592,500		
積み終了先	4,591,600	4月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,591,400	積数	5,800
非準備預金先	664,400	1日平均	200

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 99.84% 日数 16.67%

●短期金融市場関連指標

2021/4/20	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.092	0.080	0.000	29,100.38	▲ 584.99	108.11-12	108.40-41
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.110						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	0.050	0.150	0.086				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.008	▲ 0.006	▲ 0.007				-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.109						
1M			0.050				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.103	▲ 0.111						
6M							▲ 0.112	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.137						
									日付	4/13	4/14	4/15	4/16	4/19
									日銀当預残	5,170,800	5,175,300	5,265,400	5,271,700	5,273,000
									準備預金残	4,544,800	4,556,200	4,629,900	4,621,000	4,627,800
									マネタリーベース	6,378,300	6,383,000	6,474,000	6,480,300	6,482,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.010%	▲ 0.014%	▲ 0.013%
									コール市場残高	135,084	142,389	134,047	159,256	161,230
									うち無担	115,076	121,789	113,386	139,901	140,566
									うちO/N	65,423	73,996	68,803	89,233	87,428
									うち有担	20,008	20,600	20,661	19,355	20,664

●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)
20年利付国債	176	0.50%	12,000	2021/4/21	2041/3/20	32,155.0	9,618.0	101.1000	0.4390%	79.6285%	101.1200	0.4380%	2,374.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/5/7	2021/11/4	423,358.0	11,000.34		0.0000%	2.5984%		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	応札総額(億円・百万ドル)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均貸付レート・利回較差・価格較差	貸付比率
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/4/21	2021/5/12		3,431	3,431				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/20	2021/4/21	▲ 0.350	90	90		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/20	2021/4/21	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2021/4/22	2021/4/30	0.320	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/22	2021/7/15	0.330	0	0				

●2021年4月21日の予定

*英国3月の消費者物価指数

◆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