

Central Daily Market Report

2021年4月23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23日		2021年4月26日		2021年4月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 2,100		▲ 3,000	
財政	21,000		▲ 1,200		▲ 1,000	
資金過不足	19,000		▲ 3,300		▲ 4,000	
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		▲ 100		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 600	800			
新型コロナウイルス対応金融支援特別	47,200	▲ 27,600				
E T F 買入	200					
国債補完供給	▲ 400	100		400		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	37,800		▲ 2,700		▲ 4,000	
当座預金残高	5,308,500		5,305,800		5,301,800	
準備預金残高	4,641,700					
積み終了先	4,641,300		4月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,641,100		積数		2,100	
非準備預金先	666,800		1日平均		100	
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	99.94%	日数	33.33%		

●2021年4月23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▲0.030～▲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(4/26-4/27)は、▲0.09～▲0.085%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＞

本日はTB3M物(990回)の入札が実施された。WI取引において▲0.103～▲0.102%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1035%、按分落札利回▲0.1023%と、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.108～▲0.107%出会いと堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.112%で出合った。

＜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1,500億円程度に対して、発行総額は3,500億円程度と大きく発行超であった。機械・ガス業態において大型発行が見られ、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。

●短期金融市場関連指標

2021/4/23	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	▲ 0.012				-	▲ 0.094	0.065	0.000	29,020.63	▲ 167.54	107.99-00	107.91-92
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.009				-	▲ 0.104						
2W			▲ 0.100				-	▲ 0.103						
3W	▲ 0.009	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.104						
1M			0.030				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.108	▲ 0.107						
6M							▲ 0.112	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.137						
									日付	4/16	4/19	4/20	4/21	4/22
									日銀当預残	5,271,700	5,273,000	5,256,900	5,248,800	5,270,700
									準備預金残	4,621,000	4,627,800	4,595,400	4,587,000	4,610,400
									マネタリーベース	6,480,300	6,482,300	6,466,700	6,459,800	6,483,900
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.013%
									コール市場残高	159,256	161,230	169,987	171,756	171,119
									うち無担	139,901	140,566	149,902	151,584	151,263
									うちO/N	89,233	87,428	95,844	95,811	96,340
									うち有担	19,355	20,664	20,085	20,172	19,856

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	990	-	65,000	2021/4/26	2021/8/2	226,150.0	53,012.3	100.0275	▲0.1023%	67.8670%	100.0278	▲0.1035%	11,987	
交付税特会	-	-	11,000	2021/5/11	2021/11/10	407,220.0	10,990.12		0.0000%	2.6989%		0.0000%		10.0

●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	申込総額(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)		2021/4/23	2021/4/26	▲0.350	402	402		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/23	2021/4/26	▲0.350	0	0				

●2021年4月26日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、27日まで)
- *米国3月の耐久財新規受注
- *2月の景気動向指数改訂状況
- *3月の企業向けサービス価格指数

◆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