

Central Daily Market Report

2021年4月26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26日		2021年4月27日		2021年4月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 2,700		▲ 3,000	
財政	▲ 5,000		4,900		12,000	
資金過不足	▲ 7,100		2,200		9,000	
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			13,900			
CP等買入		▲ 600		▲ 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	800					
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 200	400		200		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	▲ 6,700		16,100		9,000	
当座預金残高	5,301,800		5,317,900		5,326,900	
準備預金残高	4,637,400					
積み終了先	4,637,000			4月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,637,000			積数	1,700	
非準備預金先	664,400			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	99.95%	日数	36.67%		

●2021年4月26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%での調達で始まった。引き続き強めの地合いに変化はなく、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(4/27-4/28)は、▲0.105～▲0.095%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2Y414～423、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、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は機械、石油・石炭、輸送機器業態において大型発行が実施された。償還総額1,800億円程度に対して、発行総額は3,400億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。本日はCP等買入オベが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は平均落札レート▲0.017%、按分レート▲0.024%と前回比で平均・按分ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2021/4/26	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				-	▲ 0.099	0.070	0.005	29,126.23	105.60	107.88-90	107.71-72
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.004	▲ 0.006				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.009	▲ 0.007	▲ 0.008				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.108	▲ 0.108						
6M							▲ 0.112	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	4/19	4/20	4/21	4/22	4/23
									日銀当預残	5,273,000	5,256,900	5,248,800	5,270,700	5,308,500
									準備預金残	4,627,800	4,595,400	4,587,000	4,610,400	4,641,700
									マネタリーベース	6,482,300	6,466,700	6,459,800	6,483,900	6,523,700
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.012%
									コール市場残高	161,230	169,987	171,756	171,119	171,215
									うち無担	140,566	149,902	151,584	151,263	151,655
									うちO/N	87,428	95,844	95,811	96,340	92,572
									うち有担	20,664	20,085	20,172	19,856	19,560

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非償額競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	応募総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/4/27			13,502	4,755	0.001		0.002	29.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/4/27			13,546	4,505	0.000		0.001	5.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/4/27			14,950	4,508	0.002		0.003	89.2
CP等買入	4,000	2021/4/30			9,490	3,985	▲0.024		▲0.017	41.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/26	2021/4/27	▲ 0.350	177	177		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/26	2021/4/27	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年4月27日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米国FOMC(1日目)
*黒田日銀総裁定例会見	*2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*経済・物価情勢の展望	*4月の米CB消費者信頼感指数

◆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