

Central Daily Market Report

2021年4月27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27日 需給速報	2021年4月28日 需給予想	2021年4月30日 当社予想			
銀行券	▲ 2,900	▲ 2,800	▲ 3,000			
財政	3,800	7,700	11,000			
資金過不足	900	4,900	8,000			
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		▲ 200	▲ 300	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			▲ 100			
新型コロナ対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 1,700	200	1,700			
米ドル資金供給用担保提供						
当増減	13,100	6,200	12,000			
当座預金残高	5,314,900	5,321,100	5,333,100			
準備預金残高	4,647,300					
積み終了先	4,647,000			4月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,647,000			積数	1,400	
非準備預金先	667,600			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	99.96%	日数	40.00%		

●2021年4月27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。引き続き調達意欲は強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出会いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(4/28-4/30)は、▲0.095～▲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＞

CP発行市場は月末発行にあたり電気・ガス業態で大型発行が実施されたほか、情報・通信、ゴム製品業態においてもまとまった額の発行が実施された。償還総額4,200億円程度に対して、発行総額は3,800億円程度と若干の償還超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/4/27	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	
	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)
単位：%									0.080	0.010	28,991.89	▲ 134.34	108.19-21	108.33-34
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.092						
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.096						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W	▲ 0.007	▲ 0.006	▲ 0.006				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.017				-	▲ 0.106						
3W			0.150				-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.108	▲ 0.108						
6M							▲ 0.112	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	4/20	4/21	4/22	4/23	4/26
									日銀当預残	5,256,900	5,248,800	5,270,700	5,308,500	5,301,800
									準備預金残	4,595,400	4,587,000	4,610,400	4,641,700	4,637,400
									マネタリーベース	6,466,700	6,459,800	6,483,900	6,523,700	6,519,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.012%
									コール市場残高	169,987	171,756	171,119	171,215	171,209
									うち無担	149,902	151,584	151,263	151,655	150,480
									うちO/N	95,844	95,811	96,340	92,572	93,767
									うち有担	20,085	20,172	19,856	19,560	20,729

●入札結果

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)		2021/4/27	2021/4/28	▲ 0.350	1,656	1,656		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/27	2021/4/28	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/30	2021/5/13	0.330	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/30	2021/7/15	0.330	0	0				

●2021年4月28日の予定

*3月の商業動態統計速報

*米国FOMC(2日目)

*2年利付国債入札(30,000億円、5/6発行)

*交付税特別会計借入(11,000億円、5/14借入)

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。

(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)

①ETFおよびJ-REITについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ベースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。

②CP等、社債等については、2021年9月末までの間、合計で約20兆円の残高を上限に、買入れを行う。

◆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