

Central Daily Market Report

2021年4月28日(水)
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28日 需給速報	2021年4月30日 需給予想	2021年5月6日 当社予想
銀行券	▲ 2,800	▲ 900	4,000
財政	7,900	3,400	▲ 24,000
資金過不足	5,100	2,500	▲ 20,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		7,500	
国債買入			
CP等買入	▲ 300	4,000	▲ 4,700
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	▲ 200	
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
ETF買入			
国債補充供給	▲ 300	1,700	300
※ドル資金供給用担保提供供給			
当増減	6,100	9,400	▲ 20,000
当座預金残高	5,321,000	5,330,400	5,310,400
準備預金残高	4,650,900		
積み終了先	4,650,500		4月30日以降の残り所要積立額
超過準備	4,650,500		積数
非準備預金先	670,100		1日平均
			0
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	99.98%	日数
			46.67%

●2021年4月28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。引き続き調達ニーズは強く、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、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/30~5/6)は、▲0.110~▲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、短国買入オペが前回と同額の7,500億円でオフアされ、平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+0.003%と、やや弱めな結果となった。マーケット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発行市場は鉄鋼業態において大型発行が実施された。償還総額900億円程度に対して、発行総額は1,250億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。

●短期金融市場関連指標

2021/4/28	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:%									0.090	0.010	29,053.97	62.08	108.75-76	109.01-03
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.095						
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.103						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.015	0.010	▲ 0.007				-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.010	▲ 0.002	▲ 0.008				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.108	▲ 0.109						
6M							▲ 0.112	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	4/21	4/22	4/23	4/26	4/27
									日銀当預残	5,248,800	5,270,700	5,308,500	5,301,800	5,314,900
									準備預金残	4,587,000	4,610,400	4,641,700	4,637,400	4,647,300
									マネタリーベース	6,459,800	6,483,900	6,523,700	6,519,100	6,535,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.013%
									コール市場残高	171,756	171,119	171,215	171,209	174,867
									うち無担	151,584	151,263	151,655	150,480	152,962
									うちO/N	95,811	96,340	92,572	93,767	96,049
									うち有担	20,172	19,856	19,560	20,729	21,905

●入札結果

名称	回数	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非備格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	424	0.005%	30,000	2021/5/6	2023/5/1	109,970.0	24,483.0	100.2650	▲0.1280%	62.8454%	100.2700	▲0.1300%	5,508	
交付税特会	-	-	11,000	2021/5/14	2021/11/12	405,502.0	10,990.13		0.0000%	2.7103%		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	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
国庫短期証券買入	7,500	2021/4/30			30,181	7,505	0.003		0.005	4.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/28	2021/4/30	▲ 0.350	301	301		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/28	2021/4/30	▲ 0.350	0	0				

●2021年4月29日の予定

*昭和の日

*米国1-3月期のGDP速報値

●2021年4月30日の予定

*3月の完全失業率(市場予想:2.9%)
*3月の有効求人倍率(市場予想:1.09倍)
*4月の都区部消費者物価指数(GPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)0.0%)

*3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
(市場予想:前月比▲2.0%)
*4月の消費動向調査
*3月の住宅着工統計

*米国3月の個人所得・消費支出
*米国4月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏4月の消費者物価指数速報値
*1-3月期のユーロ圏GDP1次速報

◆本資料は信頼できるとさ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ことがあります。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