

Central Daily Market Report

2021年4月30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30日		2021年5月6日		2021年5月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		3,000		3,000	
財政	4,100		▲ 31,600		▲ 42,000	
資金過不足	3,200		▲ 28,600		▲ 39,000	
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	7,500					
国債買入						
CP等買入	4,000	▲ 4,700		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	300		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	9,700		▲ 28,500		▲ 39,000	
当座預金残高	5,330,700		5,302,200		5,263,200	
準備預金残高	4,665,300					
積み終了先	4,665,300		5月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,665,200		積数		200	
非準備預金先	665,400		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	99.99%	日数	66.67%		

●2021年4月30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~▲0.003%での調達で始まった。月末要因で若干レートが低下したものの、強めの調達ニーズは変わらず、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(5/6-5/7)は、▲0.100~▲0.085%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発行市場は償還が110億円程度に対して、発行は無く、閑散なマーケットとなった。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

2021/4/30	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.096	0.090	0.000	28,812.63	▲ 241.34	108.90-91	108.88-89
T/N	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.099						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.015	▲ 0.003	▲ 0.007				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.008	0.480	0.028				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.108	▲ 0.108						
6M							▲ 0.112	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	4/22	4/23	4/26	4/27	4/28
									日銀当預残	5,270,700	5,308,500	5,301,800	5,314,900	5,321,000
									準備預金残	4,610,400	4,641,700	4,637,400	4,647,300	4,650,900
									マネタリーベース	6,483,900	6,523,700	6,519,100	6,535,100	6,544,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.012%	▲ 0.013%	▲ 0.014%
									コール市場残高	171,119	171,215	171,209	174,867	174,914
									うち無担	151,263	151,655	150,480	152,962	153,454
									うちO/N	96,340	92,572	93,767	96,049	97,081
									うち有担	19,856	19,560	20,729	21,905	21,460

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(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)		2021/4/30	2021/5/6	▲ 0.350	365	365		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/30	2021/5/6	▲ 0.350	0	0				

●2021年5月3日の予定

*憲法記念日
*米国3月の建設支出
*米国4月のISM 製造業景況指数
*London祝日(May Day)

●2021年5月4日の予定

*みどりの日
*米国3月の貿易収支
*米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫

●2021年5月5日の予定

*こどもの日
*米国4月のISM 非製造業景況指数

●2021年5月6日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(3月18・19日分)
*英中銀MPC結果発表

*国庫短期証券(991回)入札
(6ヶ月、34,000億円、5/10発行)

◆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