

Central Daily Market Report

2021年5月6日(木)

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5月6日		2021年5月7日		2021年5月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,000		3,200		2,000	
財政	▲ 32,800		▲ 28,700		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 29,800		▲ 25,500		▲ 6,000	
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			7,000			
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300	400		300		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	▲ 30,000		▲ 18,300		▲ 6,000	
当座預金残高	5,300,700		5,282,400		5,276,400	
準備預金残高	4,675,200					
積み終了先	4,675,100		5月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,675,100		積数		200	
非準備預金先	625,500		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	70.00%		

●2021年5月6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・証券業態を中心に▲0.03~▲0.002%の出会いとなった。調達ニーズは変わらず強めだったものの、連休明けということもあって、若干レートが低下した。一巡後は▲0.035~▲0.025%の出会いが散見された。ターム物はショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(5/7-5/10)は、▲0.090~▲0.080%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TB6M物(991回)の入札が実施された。WI取引において▲0.112%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1090%、按分落札利回▲0.1050%と、やや軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.106%出合いと、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、発行・償還共に100億円程度と閑散。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/5/6	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)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.087	0.085	▲ 0.005	29,331.37	518.74	109.22-23	109.33-34
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.007	▲ 0.003	▲ 0.004				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.007				-	▲ 0.096						
3W	▲ 0.005	0.100	0.038				-	▲ 0.100						
1M	▲ 0.030	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.108	▲ 0.107						
6M							▲ 0.109	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.137						
									日付	4/23	4/26	4/27	4/28	4/30
									日経当預残	5,308,500	5,301,800	5,314,900	5,321,000	5,330,700
									準備預金残	4,641,700	4,637,400	4,647,300	4,650,900	4,665,300
									マネタリーベース	6,523,700	6,519,100	6,535,100	6,544,100	6,554,600
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.012%	▲0.013%	▲0.014%	▲0.017%
									コール市場残高	171,215	171,209	174,867	174,914	168,237
									うち無担	151,655	150,480	152,962	153,454	146,716
									うちO/N	92,572	93,767	96,049	97,081	94,468
									うち有担	19,560	20,729	21,905	21,460	21,521

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	991	-	34,000	2021/5/10	2021/11/10	95,857.0	27,720.7	100.0530	▲0.1050%	31.1050%	100.0550	▲0.1090%	6,279.0

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/5/7			9,885	4,502	▲0.007		▲0.005	40.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2021/5/7			5,198	2,012	▲0.004		▲0.003	29.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/6	2021/5/7	▲ 0.350	285	285		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/6	2021/5/7	▲ 0.350	0	0				

●2021年5月7日の予定

*3月の毎月勤労統計調査速報	*米国3月の卸売売上高	*国庫短期証券(992回)入札
*4月実績/5月見込み財政資金対民間収支	*米国3月の消費者信用残高	(3ヶ月、65,000億円、5/10発行)
*4月のマネタリーベース	*米国4月の雇用統計	*流動性供給入札(4,000億円、5/10発行)
		*エネルギー対策借入(8,000億円、5/20借入)

◆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