

# Central Daily Market Report

2021年5月7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5月7日		2021年5月10日		2021年5月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,100		2,100		2,000	
財政	▲ 32,800		▲ 9,700		1,000	
資金過不足	▲ 29,700		▲ 7,600		3,000	
<b>金融調節</b>						
	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		▲ 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	▲ 400	300		400		
<small>*ドル資金供給用担保提供枠</small>						
当増増減	▲ 22,900		▲ 7,200		3,000	
当座預金残高	5,277,800		5,270,600		5,273,600	
準備預金残高	4,644,800					
積み終了先	4,644,800		5月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,644,800		積数		100	
非準備預金先	633,000		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	100.00%	日数	80.00%		

## ●2021年5月7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~▲0.004%の出会いとなった。各業態の調達姿勢に変化はほとんど見られず、出会い水準は前日とほぼ横ばいとなった。一巡後は▲0.03~▲0.02%のレンジの出会いで推移した。ターム物は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(5/10-5/11)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。SCはローラー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TB3M物(992回)の入札が実施された。WI取引において▲0.106~▲0.103%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1043%、按分落札利回▲0.1011%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.105~▲0.103%出会いと、底堅く推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額は900億円程度に対し、発行総額は500億円程度となった。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

2021/5/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.016				-	▲ 0.081	0.080	▲ 0.005	29,357.82	26.45	109.04-06	109.14-16
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.010				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.009	0.095	0.034				-	▲ 0.091						
3W	▲ 0.013	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.018	▲ 0.006	▲ 0.011				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.104	▲ 0.105						
6M							▲ 0.109	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.137						
									日付	4/26	4/27	4/28	4/30	5/6
									日銀当預残	5,301,800	5,314,900	5,321,000	5,330,700	5,300,700
									準備預金残	4,637,400	4,647,300	4,650,900	4,665,300	4,673,600
									マネタリーベース	6,519,100	6,535,100	6,544,100	6,554,600	6,521,700
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.013%	▲0.014%	▲0.017%	▲0.016%
									コール市場残高	171,209	174,867	174,914	168,237	151,213
									うち無担	150,480	152,962	153,454	146,716	131,989
									うちO/N	93,767	96,049	97,081	94,468	80,126
									うち有担	20,729	21,905	21,460	21,521	19,224

## ●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	992	-	65,000	2021/5/10	2021/8/10	176,916.0	53,088.2	100.0255	▲0.1011%	56.7777%	100.0263	▲0.1043%	11,911.0
流動性供給	333	-	4,000	2021/5/10		18,026.0	3,977.0		▲0.0040%	93.2832%		▲0.0050%	
エネルギー対策	-	-	8,000	2021/5/20	2022/5/20	226,310.0	7,999.76		0.0000%	3.5349%		0.0000%	

## ●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)		2021/5/7	2021/5/10	▲ 0.350	379	379		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/7	2021/5/10	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年5月10日の予定

\*5月の日銀当座預金増減要因見込み

◆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