

# Central Daily Market Report

2021年5月10日(月)  
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10日		2021年5月11日		2021年5月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,100		1,700		2,000	
財政	▲ 10,200		300		▲ 32,000	
資金過不足	▲ 8,100		2,000		▲ 30,000	
<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						▲ 3,400
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,300			
CP等買入				▲ 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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 1,600	400		1,600		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 9,300		12,600		▲ 33,400	
当座預金残高	5,268,500		5,281,100		5,247,700	
準備預金残高	4,634,100					
積み終了先	4,634,100		5月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,634,100		積数		100	
非準備預金先	634,400		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	100.00%	日数	83.33%		

## ●2021年5月10日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、先週とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.03～▲0.005%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.045～▲0.015%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(5/11-5/12)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2Y410～424、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、6M物が▲0.117%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額は少額にとどまり、発行総額は450億円程度と閑散。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

2021/5/10	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	
	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.083	0.080	0.000	29,518.34	160.52	108.57-58	108.91-93
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.030	0.150	▲ 0.010				-	▲ 0.088						
2W			0.001				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M			0.000				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.104	▲ 0.104						
6M							▲ 0.118	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	4/27	4/28	4/30	5/6	5/7
									日銀当預残	5,314,900	5,321,000	5,330,700	5,300,700	5,277,800
									準備預金残	4,647,300	4,650,900	4,665,300	4,673,600	4,644,800
									マネタリーベース	6,535,100	6,544,100	6,554,600	6,521,700	6,495,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.014%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.016%
									コール市場残高	174,867	174,914	168,237	151,213	153,829
									うち無担	152,962	153,454	146,716	131,989	134,331
									うちO/N	96,049	97,081	94,468	80,126	82,333
									うち有担	21,905	21,460	21,521	19,224	19,498

## ●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	棄分率	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/5/11			16,136	4,755	0.001		0.002	9.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/5/11			14,846	4,508	0.002		0.002	59.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/10	2021/5/11	▲ 0.350	1,532	1,532		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/10	2021/5/11	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年5月11日の予定

*3月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.5%)	*10年利付国債入札(26,000億円、5/12発行)
*決定会合における主な意見(4月26・27日分)	*交付税特別会計借入(11,000億円、5/21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