

Central Daily Market Report

2021年5月11日(火)
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11日 需給速報	2021年5月12日 需給予想	2021年5月13日 当社予想
銀行券	1,700	1,100	1,000
財政	1,800	▲ 32,200	0
資金過不足	3,500	▲ 31,100	1,000

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			2,900	▲ 3,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入	9,300					
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	▲ 200	1,600		200		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	13,900	▲ 21,500				1,000

当座預金残高	5,282,400	5,260,900	5,261,900
準備預金残高	4,628,600		
積み終了先	4,628,500		5月12日以降の残り所要積立額
超過準備	4,628,500		積数
非準備預金先	653,800		1日平均
			100
			0

積み期間(4/16~5/15)の所要準備額	3,597,700
準備預金進捗率	実績 100.00% 日数 86.67%

●2021年5月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態の調達姿勢にあまり変化が見られず、昨日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~▲0.006%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.045~▲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(5/12-5/13)は、▲0.100~▲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、短国買入オペアが前回より2,500億円増額の10,000億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差+0.003%と、無難な結果となった。マーケットは動意なく閑散中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、発行・償還共に300億円程度と閑散。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

2021/5/11	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.086	0.070	▲ 0.010	28,608.59	▲ 909.75	108.84-85	108.94-95
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.009	▲ 0.012				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.006	0.020	0.007				-	▲ 0.091						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.104	▲ 0.104						
6M							▲ 0.115	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						

日付	4/28	4/30	5/6	5/7	5/10
日銀当預残	5,321,000	5,330,700	5,300,700	5,277,800	5,268,500
準備預金残	4,650,900	4,665,300	4,673,600	4,644,800	4,634,100
マネタリーベース	6,544,100	6,554,600	6,521,700	6,495,800	6,484,400
無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.016%
コール市場残高	174,914	168,237	151,213	153,829	160,634
うち無担	153,454	146,716	131,989	134,331	141,165
うちO/N	97,081	94,468	80,126	82,333	90,932
うち有担	21,460	21,521	19,224	19,498	19,469

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	362	0.100%	26,000	2021/5/12	2031/3/20	64,100.0	21,099.0	100.2500	0.0740%	30.3800%	100.2700	0.0720%	4,892	2.95
交付税特会	-	-	11,000	2021/5/21	2021/11/18	436,749.0	10,990.16		0.0000%	2.5164%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2021/5/12	2021/5/26		2,871	2,871				
国庫短期証券買入	10,000	2021/5/12			30,080	10,003	0.003		0.003	95.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/11	2021/5/12	▲ 0.350	210	210		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/11	2021/5/12	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/5/13	2021/5/20	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/5/13	2021/8/5	0.320	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/5/14			2,700	1,252	▲ 0.060		▲ 0.055	14.1

●2021年5月12日の予定

*3月の景気動向指数速報	*米国4月の財政収支
*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国4月の消費者物価指数
	*英国1-3月期のGDP速報値

◆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