

Central Daily Market Report

2021年5月12日(水)

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12日		2021年5月13日		2021年5月14日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	1,000		600			0
財政	▲ 32,600		3,900			▲ 9,000
資金過不足	▲ 31,600		4,500			▲ 9,000
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						300
社債等買入						1,300
新型コロナ対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 22,100		4,500			▲ 7,800
当座預金残高	5,260,300		5,264,800			5,257,000
準備預金残高	4,625,800					
積み終了先	4,625,800				5月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,625,800				積数	0
非準備預金先	634,500				1日平均	0
積み期間 (4/16~5/15) の所要準備額						3,597,100
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.00%		

●2021年5月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き全体的なビッド状況にあまり変化がなく、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～▲0.007%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.04～▲0.015%のレンジの出合いで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(5/13-5/14)は、▲0.090～▲0.080%程度での出合い。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2Y410～424、5Y140～147、10Y345～362、20Y170～176、30Y59～70、40Y10～13等にビッドの入りがあつた。

<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、15日の前倒し発行にあたり、償還総額は1,800億円程度に対して発行総額は2,000億円程度となった。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

2021/5/12	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.082	0.075	0.005	28,147.51	▲ 461.08	108.71-72	108.79-80
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W			▲ 0.006				-	▲ 0.090						
2W			▲ 0.002				-	▲ 0.091						
3W			0.001				-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.040	0.050	0.011				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.104	▲ 0.104						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	4/30	5/6	5/7	5/10	5/11
									日経当預残	5,330,700	5,300,700	5,277,800	5,268,500	5,282,400
									準備預金残	4,665,300	4,673,600	4,644,800	4,634,100	4,628,600
									マネタリーベース	6,554,600	6,521,700	6,495,800	6,484,400	6,496,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.015%
									コール市場残高	168,237	151,213	153,829	160,634	150,739
									うち無担	146,716	131,989	134,331	141,165	131,217
									うちO/N	94,468	80,126	82,333	90,932	78,034
									うち有担	21,521	19,224	19,498	19,469	19,522

●入札結果

名称	回数	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	応募総額(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)		2021/5/12	2021/5/13	▲ 0.350	120	120		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/12	2021/5/13	▲ 0.350	7	7		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第11回	2021/5/14	2023/5/12	0	300

●2021年5月13日の予定

*3月の国際収支	*米国4月の生産者物価指数	*30年利付国債入札(9,000億円、5/14発行)
*4月の景気ウォッチャー調査		

◆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