

Central Daily Market Report

2021年5月13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13日		2021年5月14日		2021年5月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		1,100		1,000	
財政	3,800		▲ 6,800		▲ 5,000	
資金過不足	4,500		▲ 5,700		▲ 4,000	
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			300	▲ 400		
社債等買入			1,300			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	4,500		▲ 5,600		▲ 4,000	
当座預金残高	5,264,800		5,259,200		5,255,200	
準備預金残高	4,632,100					
積み終了先	4,632,100				5月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,632,100				積数	0
非準備預金先	632,700				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	93.33%		

●2021年5月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日に向けてややレートを引き上げる先も現れているものの、全体の出会い水準に大きな変化はなかった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.025~▲0.007%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.04~▲0.01%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>

GCT/N(5/14-5/17)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。SCI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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,100億円程度に対し発行総額は800億円程度。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

2021/5/13	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.082	0.090	0.015	27,448.01	▲ 699.50	109.66-68	109.66-68
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.009	▲ 0.009				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.015	▲ 0.003	▲ 0.008				-	▲ 0.091						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.010	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.099						
3M			0.005				▲ 0.102	▲ 0.104						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	5/6	5/7	5/10	5/11	5/12
									日銀当預残	5,300,700	5,277,800	5,268,500	5,282,400	5,260,300
									準備預金残	4,673,600	4,644,800	4,634,100	4,628,600	4,625,800
									マネタリーベース	6,521,700	6,495,800	6,484,400	6,496,600	6,473,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.015%	▲ 0.016%
									コール市場残高	151,213	153,829	160,634	150,739	160,489
									うち無担	131,989	134,331	141,165	131,217	140,292
									うちO/N	80,126	82,333	90,932	78,034	85,689
									うち有担	19,224	19,498	19,469	19,522	20,197

●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)
30年利付国債	70	0.70%	9,000	2021/5/14	2051/3/20	23,136.0	7,422.0	101.2500	0.6490%	67.9449%	101.3600	0.6450%	1,568.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/13	2021/5/14	▲ 0.350	9	9		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/13	2021/5/14	▲ 0.350	0	0				

●2021年5月14日の予定

*3月の特定サービス産業動態統計速報	*米国3月の企業在庫	*国庫短期証券(993回)入札(3ヶ月、65,000億円、5/17発行)
*4月のマネーストック	*米国4月の小売売上高	*国有林野借入(638億円、5/25借入)
	*米国4月の鉱工業生産・設備稼働率	
	*米国5月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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