

Central Daily Market Report

2021年5月14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14日		2021年5月17日		2021年5月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		1,200		1,000	
財政	▲ 6,500		▲ 4,900		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 5,400		▲ 3,700		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			14,000			
CP等買入		▲ 1,100		▲ 600		
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	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 5,500		9,900		▲ 1,000	
当座預金残高	5,259,300		5,269,200		5,268,200	
準備預金残高	4,646,300					
積み終了先	4,646,300		5月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,646,300		積数	436,200		
非準備預金先	613,000		1日平均	14,500		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,743,300	
準備預金進捗率	実績	88.35%	日数	3.23%		

●2021年5月14日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、積み最終日のため調達ニーズが高まり、昨日よりも高めの水準で取引が行われた。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.015~▲0.004%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲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＞

GC T/N(5/17-5/18)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＞

本日はTB3M物(993回)の入札が実施された。WI取引においては▲0.102~▲0.100%の気配が見られる中、平均落札利回▲0.0998%、按分落札利回▲0.0982%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~▲0.104%出会いと、堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額は少額に対し発行総額は350億円程度と閑散。発行レートは、概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入入pegが、予定通りの4,000億円でおfferされた。平均落札レート▲0.011%、按分レート▲0.014%と、前回比で平均・按分共に上昇した。

●短期金融市場関連指標

2021/5/14	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.082	0.080	▲ 0.010	28,084.47	636.46	109.51-52	109.38-39
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.010	0.010	▲ 0.007				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.002				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.098						
3M			0.200				▲ 0.105	▲ 0.102						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136						
									日付	5/7	5/10	5/11	5/12	5/13
									日銀当預残	5,277,800	5,268,500	5,282,400	5,260,300	5,264,800
									準備預金残	4,644,800	4,634,100	4,628,600	4,625,800	4,632,100
									マネタリーベース	6,495,800	6,484,400	6,496,600	6,473,400	6,477,300
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.014%
									コール市場残高	153,829	160,634	150,739	160,489	156,028
									うち無担	134,331	141,165	131,217	140,292	134,505
									うちO/N	82,333	90,932	78,034	85,689	80,492
									うち有担	19,498	19,469	19,522	20,197	21,523

●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	993	-	65,000	2021/5/17	2021/8/16	211,777.9	53,078.1	100.0245	▲0.0982%	76.6471%	100.0249	▲0.0998%	11,921.0
国有林野借入	-	-	638	2021/5/25	2026/5/25	3,691.0	638.00		0.0000%	25.0000%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/5/17			14,686	4,761	▲0.002		▲0.001	54.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/5/17			14,006	4,509	▲0.007		▲0.006	79.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/5/17			9,783	4,502	▲0.011		▲0.009	25.5
CP等買入	4,000	2021/5/19			11,340	3,990	▲0.014		▲0.011	74.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/14	2021/5/17	▲0.350	150	150		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/14	2021/5/17	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	

●2021年5月17日の予定

*4月の企業物価指数	*10年物価連動国債入札(2,000億円、5/18発行)
------------	------------------------------

◆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