Central Daily Market Report

2021年5月17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17日 需給速報	2021年5月18日 需給予想	2021年5月19日 当社予想
銀行券	1,200	1,100	0
財政	▲ 4,200	▲ 300	2,000
資金過不足	▲ 3,000	800	2,000

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		▲ 600		▲ 200	4,000	
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	10,600		600		6,000	

当座預金残高	5,269,900	5,270,500	5,276,500
準備預金残高	4,618,200		
積み終了先	4,574,000		
超過準備	4,208,600		
非準備預金先	651,700		

5月18日以降の残り所要積立額	
積数	26,500
1日平均	900

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	99.29%	日数 6.45%

●2021年5月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.025～▲0.007%の調達で始まった。新しい積み期間に入り、基準比率が低下したものの、地銀業態では調達意欲は強く、レートは高止まりとなった。一巡後は▲0.06～▲0.01%近辺の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートターム物の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(5/18-5/19)は、▲0.090～▲0.080%程度での出合い。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、3M物が▲0.108%、6M物が▲0.115%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額300億円強に対して、発行総額800億円弱となった。電力から大型発行が見られたが、他は小口の案件が中心であった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/5/17	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.015				－	▲ 0.084
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				－	▲ 0.090
S/N			▲ 0.011				－	－
1W			▲ 0.010				－	▲ 0.091
2W	▲ 0.012	0.000	▲ 0.007				－	▲ 0.092
3W			▲ 0.007				－	▲ 0.096
1M	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				－	▲ 0.100
3M							▲ 0.108	▲ 0.103
6M							▲ 0.115	▲ 0.116
1Y							▲ 0.128	▲ 0.137

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.075	▲ 0.005	27,824.83	▲ 259.64	109.42-43	109.24-26

日付	5/10	5/11	5/12	5/13	5/14
日銀当預残	5,268,500	5,282,400	5,260,300	5,264,800	5,259,300
準備預金残	4,634,100	4,628,600	4,625,800	4,632,100	4,646,300
マネタリーベース	6,484,400	6,496,600	6,473,400	6,477,300	6,470,700
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.014%	▲0.011%
コール市場残高	160,634	150,739	160,489	156,028	131,375
うち無担	141,165	131,217	140,292	134,505	111,643
うちO/N	90,932	78,034	85,689	80,492	64,290
うち有担	19,469	19,522	20,197	21,523	19,732

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
物価連動10年	26	0.005%	2,000	2021/5/18	2031/3/10	7,632.0	1,999.00	101.9000	▲0.1850%	30.2491%			

●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）		2021/5/17	2021/5/18	▲ 0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/5/17	2021/5/18	▲ 0.350	0	0				

●2021年5月18日の予定

*1-3月期のGDP1次速報（市場予想：前期比年率▲4.6%）
*3月の第3次産業活動指数
*米国4月の住宅着工件数
*ユーロ圏1-3月期のGDP2次速報

◆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。
◆本資料は何ら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論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