Central Daily Market Report

2021年5月18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18日 需給速報		2021年5月19日 需給予想		2021年5月20日 当社予想	
銀行券	1,100		400		▲ 1,000	
財政	2,900		0		▲ 38,000	
資金過不足	4,000		400		▲ 39,000	
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			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200	4,000	▲ 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						
ＥＴＦ買入			400			
国債補完供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	3,600		14,900		▲ 39,000	

当座預金残高	5,273,500	5,288,400	5,249,400
準備預金残高	4,626,400		
積み終了先	4,623,500		
超過準備	4,609,600		
非準備預金先	647,100		

5月19日以降の残り所要積立額	
積数	9,600
1日平均	300

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	99.74%	日数 9.68%

●2021年5月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・証券より▲0.025～▲0.005%の調達で始まった。引き続き地銀業態では調達意欲は高く、一部では取り上がる動きが見られた。一巡後は▲0.07～▲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見られた。

<レポ市場>

GC T/N(5/19-5/20)は、▲0.100～▲0.090%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、短国買入オペが前回と同額の10,000億円でオファーされ、平均落札利回較差、按分落札利回較差ともに+0.006%と、やや弱めの結果となった。マーケット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発行市場は五・十日発行にあたり、石油・機械などの幅広い業態から大口発行が実施された。発行総額、償還総額はいずれも1,900億円弱の規模であった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/5/18	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	▲ 0.016				－	▲ 0.087
T/N	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.092
S/N			▲ 0.011				－	－
1W			▲ 0.012				－	▲ 0.092
2W	▲ 0.004	▲ 0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.094
3W			0.150				－	▲ 0.096
1M	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004				－	▲ 0.100
3M							▲ 0.108	▲ 0.103
6M							▲ 0.112	▲ 0.116
1Y							▲ 0.128	▲ 0.136

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	0.000	28,406.84	582.01	109.24-25	108.97-98

日付	5/11	5/12	5/13	5/14	5/17
日銀当預残	5,282,400	5,260,300	5,264,800	5,259,300	5,269,900
準備預金残	4,628,600	4,625,800	4,632,100	4,646,300	4,618,200
マネタリーベース	6,496,600	6,473,400	6,477,300	6,470,700	6,479,900
無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.016%	▲0.014%	▲0.011%	▲0.015%
コール市場残高	150,739	160,489	156,028	131,375	153,255
うち無担	131,217	140,292	134,505	111,643	132,549
うちO/N	78,034	85,689	80,492	64,290	81,761
うち有担	19,522	20,197	21,523	19,732	20,706

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ｉ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
国庫短期証券買入	10,000	2021/5/19			26,576	10,002	0.006		0.006	90.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/5/18	2021/5/19	▲ 0.350	183	183		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/5/18	2021/5/19	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/5/20	2021/5/27	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/5/20	2021/8/12	0.320	0	0				

●2021年5月19日の予定

*英国4月の消費者物価指数
*ユーロ圏4月の消費者物価指数改定値
*国庫短期証券（994回）入札（1年、35,000億円、5/20発行）
*5年利付国債入札（25,000億円、5/20発行）
*交付税特別会計借入（11,000億円、5/31借入）

◆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