

Central Daily Market Report

2021年5月19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19日 需給速報	2021年5月20日 需給予想	2021年5月21日 当社予想
銀行券	400	▲ 100	▲ 1,000
財政	1,000	▲ 32,500	▲ 1,000
資金過不足	1,400	▲ 32,600	▲ 2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
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	4,000	▲ 100	▲ 700
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			
E T F 買入	400		
国債補完供給	▲ 500	200	500
※ドル資金供給用担保提供供給			
当増減	15,400	▲ 32,800	▲ 2,000
当座預金残高	5,288,900	5,256,100	5,254,100
準備預金残高	4,635,000		
積み終了先	4,633,200		5月20日以降の残り所要積立額
超過準備	4,632,800		積数
非準備預金先	653,900		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	99.80%	日数
			12.90%

●2021年5月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、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~▲0.005%の調達が見られた。一巡後は▲0.06~▲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見られた。

<レポ市場>

GC T/N(5/20-5/21)は、▲0.095~▲0.085%程度での出会い。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、5Y140~146、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TB1Y物(994回)の入札が実施された。WI取引において▲0.12%程度を意識した気配が見られる中、平均落札利回▲0.1218%、按分落札利回▲0.1198%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▲0.123~▲0.122%出合いと、底堅く推移した。

<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600億円弱で小売・ノンバンク等から発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2021/5/19	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.096	0.070	▲ 0.005	28,044.45	▲ 362.39	109.24-25	108.97-98
T/N	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.012	▲ 0.006	▲ 0.008				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.011	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.094						
3W	▲ 0.011	0.140	0.039				-	▲ 0.096						
1M			▲ 0.007				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.108	▲ 0.104						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.136						
									日付	5/12	5/13	5/14	5/17	5/18
									日銀当預残	5,260,300	5,264,800	5,259,300	5,269,900	5,273,500
									準備預金残	4,625,800	4,632,100	4,646,300	4,618,200	4,626,500
									マネタリーベース	6,473,400	6,477,300	6,470,700	6,479,900	6,482,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.014%	▲ 0.011%	▲ 0.015%	▲ 0.016%
									コール市場残高	160,489	156,028	131,375	153,255	161,544
									うち無担	140,292	134,505	111,643	132,549	140,947
									うちO/N	85,689	80,492	64,290	81,761	84,739
									うち有担	20,197	21,523	19,732	20,706	20,597

●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	994	-	35,000	2021/5/20	2022/5/20	98,824.0	28,674.3	100.1200	▲0.1198%	98.7853%	100.1220	▲0.1218%	6,325.0
5年利付国債	147	0.005%	25,000	2021/5/20	2026/3/20	68,254.0	20,685.0	100.4900	▲0.0930%	94.3092%	100.5000	▲0.0970%	4,309.0
交付税特会	-	-	11,000	2021/5/31	2021/11/30	439,232.0	10,990.34		0.0000%	2.5022%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/19	2021/5/20	▲ 0.350	539	539		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/19	2021/5/20	▲ 0.350	0	0				

●2021年5月20日の予定

*3月の機械受注統計(市場予想：電力除く民需、前月比+6.4%)
*4月の貿易統計

◆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