

Central Daily Market Report

2021年5月20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20日 需給速報	2021年5月21日 需給予想	2021年5月24日 当社予想
銀行券	0	0	0
財政	▲ 32,500	1,100	3,000
資金過不足	▲ 32,500	1,100	3,000
金融調節			
	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			
国債買入		9,900	
CP等買入	▲ 700	▲ 400	
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			
国債補完供給	500		
※ドル資金供給用担保提供供給			
当増減	▲ 32,700	10,600	3,000
当座預金残高	5,256,200	5,266,800	5,269,800
準備預金残高	4,606,400		
積み終了先	4,605,300	5月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,604,700	積数	5,800
非準備預金先	649,800	1日平均	200
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	99.85%	日数
			16.13%

●2021年5月20日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、国内勢より▲0.03~▲0.007%の調達で始まった。ビッド状況に変化は見られず、引き続き横ばいの水準での取引となった。一巡後は▲0.07~▲0.01%近辺の出会いが見られた。ターム物はショートターム物の引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GCT/N(5/21-5/24)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＞

本日の短国市場は動意なく閑散中、1Y物が▲0.124%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額600億円弱に対して、900億円程度の発行総額となった。小売業態から大型発行が見られ、発行総額を押し上げた。発行レートに目立った変化はなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/5/20	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	
	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)
単位：%									0.080	0.010	28,098.25	53.80	109.26-27	108.97-98
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.088						
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.012	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.010				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.007	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.108	▲ 0.104						
6M							▲ 0.112	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.123	▲ 0.136						
									日付	5/13	5/14	5/17	5/18	5/19
									日銀当預残	5,264,800	5,259,300	5,269,900	5,273,500	5,288,900
									準備預金残	4,632,100	4,646,300	4,618,200	4,626,500	4,635,000
									マネタリーベース	6,477,300	6,470,700	6,479,900	6,482,500	6,497,500
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.011%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.016%
									コール市場残高	156,028	131,375	153,255	161,544	162,379
									うち無担	134,505	111,643	132,549	140,947	143,637
									うちO/N	80,492	64,290	81,761	84,739	84,879
									うち有担	21,523	19,732	20,706	20,597	18,742

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1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)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均貸付レート・利回差・価格差	貸付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/5/21			12,598	4,760	0.000		0.002	19.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2021/5/21			13,816	4,507	0.003		0.004	82.3
国債買入(残存期間25年超)	500	2021/5/21			2,275	503	0.006		0.007	76.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/20	2021/5/21	▲ 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)		2021/5/20	2021/5/21	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2021/5/25			2,756	752	0.063		0.068	64.4

●2021年5月21日の予定

*4月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.2%	*米国4月の中古住宅販売	*国庫短期証券(995回)入札 (3ヶ月、63,000億円、5/24発行)
		*20年利付国債入札 (12,000億円、5/24発行)

◆本資料は信頼できるとさ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