

# Central Daily Market Report

2021年5月21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21日		2021年5月24日		2021年5月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		200		0	
財政	1,400		3,900		▲7,000	
資金過不足	1,400		4,100		▲7,000	
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	9,900					
CP等買入		▲400		▲300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						800
新型コロナ対応金融支援特別						▲37,400
E T F 買入						
国債補完供給	▲100			100		
当預増減	10,800		3,900		▲43,600	
当座預金残高	5,267,000		5,270,900		5,227,300	
準備預金残高	4,618,000					
積み終了先	4,617,700		5月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,617,400		積数		3,800	
非準備預金先	649,000		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	99.90%	日数	25.81%		

## ●2021年5月21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~▲0.005%の調達で始まった。週末要因により一部の先では取り上がる動きが見られ、引き続き高い水準での取引となった。一巡後は▲0.06~▲0.01%近辺の出合いが見られた。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>

GC T/N(5/24-5/25)は、▲0.110~▲0.085%程度での出合い。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(995回)の入札が実施され、WI取引において▲0.103~▲0.102%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1046%、按分落札利回▲0.1042%と、順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは特段の出合いは見られなかったものの、▲0.110%での買い気配が見られるなど、やや強含んで推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、不動産・ノンバンクなどの大型発行が見られたため、償還総額600億円程度に対し、発行総額は1,900億円程度に膨らんだ。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

2021/5/21	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲0.014				-	▲0.085	0.078	▲0.002	28,317.83	219.58	108.85-86	108.69-70
T/N	▲0.009	▲0.001	▲0.004				-	▲0.087						
S/N			▲0.011				-	-						
1W	▲0.009	▲0.006	▲0.008				-	▲0.091						
2W	▲0.010	0.095	0.016				-	▲0.093						
3W							-	▲0.095						
1M							-	▲0.100						
3M							▲0.135	▲0.103						
6M							▲0.112	▲0.114						
1Y							▲0.123	▲0.136						
									日付	5/14	5/17	5/18	5/19	5/20
									日銀当預残	5,259,300	5,269,900	5,273,500	5,288,900	5,256,200
									準備預金残	4,646,300	4,618,200	4,626,500	4,635,000	4,606,400
									マネタリーベース	6,470,700	6,479,900	6,482,500	6,497,500	6,464,800
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.016%	▲0.015%
									コール市場残高	131,375	153,255	161,544	162,379	164,423
									うち無担	111,643	132,549	140,947	143,637	144,552
									うちO/N	64,290	81,761	84,739	84,879	83,264
									うち有担	19,732	20,706	20,597	18,742	19,871

## ●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	995	-	63,000	2021/5/24	2021/8/23	242,016.5	51,438.50	100.0260	▲0.1042%	86.2636%	100.0261	▲0.1046%	11,561.0
20年利付国債	176	0.500%	12,000	2021/5/24	2041/3/20	33,505.0	9,634.0	100.9000	0.4500%	37.4530%	101.0000	0.4450%	2,354.0

## ●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)		2021/5/21	2021/5/24	▲0.350	127	127		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/21	2021/5/24	▲0.350	0	0				

## ●2021年5月24日の予定

\*国庫短期証券(996回)入札  
(6ヶ月、34,000億円、5/25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