

# Central Daily Market Report

2021年5月24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24日 需給速報	2021年5月25日 需給予想	2021年5月26日 当社予想
銀行券	▲ 100	200	0
財政	1,100	▲ 2,800	8,000
資金過不足	1,000	▲ 2,600	8,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			▲ 2,900
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		9,300	
CP等買入	▲ 300	▲ 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		800	▲ 100
新型コロナ対応金融支援特別		55,500	▲ 37,400
E T F買入			
国債補完供給	▲ 300	100	300
*ドル資金供給用担保確保供給			
当増減	500	25,400	5,100
当座預金残高	5,267,500	5,292,900	5,298,000
準備預金残高	4,601,500		
積み終了先	4,601,200		5月25日以降の残り所要積立額
超過準備	4,601,200		積数 3,400
非準備預金先	666,000		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	99.91%	日数 29.03%

## ●2021年5月24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▲0.03~▲0.005%程度の水準で始まった。週末要因が剥落したものの、依然として取り手の調達ニーズは強く、レートは高止まりとなった。一巡後は▲0.06~▲0.01%近辺の水準での出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(5/25-5/26)は、▲0.105~▲0.095%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TB6M物(996回)の入札が実施され、WI取引において▲0.109~▲0.105%での気配が見られる中、平均落札利回▲0.1090%、按分落札利回▲0.1070%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▲0.115%の出合いと、堅調に推移した。この他では、3M物が▲0.135%、1Y物が▲0.130%で出合った。

### <CP市場>

CP市場は、償還が200億円弱であるのに対して、発行が170億円といずれも少額であった。発行レートは概ね横ばいながらも、発行量の少ない銘柄への積極的な応札が見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2021/5/24	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	
	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.092	0.075	▲ 0.003	28,364.61	46.78	108.91-92	108.76-77
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.005	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.098						
3W			0.140				-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.100						
3M			0.060				▲ 0.135	▲ 0.106						
6M							▲ 0.115	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/17	5/18	5/19	5/20	5/21
									日銀当預残	5,269,900	5,273,500	5,288,900	5,256,200	5,267,000
									準備預金残	4,618,200	4,626,500	4,635,000	4,606,400	4,618,000
									マネタリーベース	6,479,900	6,482,500	6,497,500	6,464,800	6,475,600
									無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.016%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.014%
									コール市場残高	153,255	161,544	162,379	164,423	169,392
									うち無担	132,549	140,947	143,637	144,552	147,972
									うちO/N	81,761	84,739	84,879	83,264	85,944
									うち有担	20,706	20,597	18,742	19,871	21,420

## ●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	996	-	34,000	2021/5/25	2021/11/25	131,645.0	27,772.0	100.0540	▲0.1070%	41.9996%	100.0550	▲0.1090%	6,227.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2021/5/25			12,199	4,753	▲0.003		▲0.001	74.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/5/25			13,931	4,510	▲0.003		▲0.002	77.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/24	2021/5/25	▲ 0.350	262	262		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/24	2021/5/25	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/5/25時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/5/25	2021/11/26	0	55,483	685,999

## ●2021年5月25日の予定

*米国3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,000億円、5/26発行)
*米国4月の新築一戸建て販売件数	*交付税特別会計借入(11,000億円、6/2借入)
*米国5月のCB消費者信頼感指数	

◆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