

Central Daily Market Report

2021年5月25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25日		2021年5月26日		2021年5月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 700	▲ 1,000			
財政	▲ 2,900	3,300	15,000			
資金過不足	▲ 2,800	2,600	14,000			
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			3,400	▲ 2,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,300					
CP等買入		▲ 400		▲ 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	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	▲ 400	300		400		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	24,800		3,400		14,000	
当座預金残高	5,292,300		5,295,700		5,309,700	
準備預金残高	4,617,500					
積み終了先	4,617,100		5月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,617,100		積数	3,000		
非準備預金先	674,800		1日平均	100		
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	99.92%	日数	32.26%		

●2021年5月25日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、ややレートを引き下げる先も見られたものの、全体的な調達ニーズに変化はなく、レートは横ばい圏内となった。立ち上がりは国内勢を中心に▲0.06~▲0.004%程度の出合いが見られた。一巡後は▲0.04~▲0.015%のレンジの出合いで推移した。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(5/26-5/27)は、▲0.105~▲0.095%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動意なく閑散な中、1Y物が▲0.133~▲0.130%で出合った。

＜CP市場＞

CP市場は、償還200億円弱に対して、発行は大型案件が実施されたことで1,100億円強と発行超であった。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

2021/5/25	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	▲ 0.016				-	▲ 0.092	0.070	▲ 0.005	28,553.98	189.37	108.84-85	108.71-73
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.100						
S/N			▲ 0.011				-	-						
1W							-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.010	▲ 0.006	▲ 0.009				-	▲ 0.099						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.100						
1M							-	▲ 0.101						
3M	0.030	0.100	0.083				▲ 0.135	▲ 0.107						
6M							▲ 0.110	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.136						
									日付	5/18	5/19	5/20	5/21	5/24
									日銀当預残	5,273,500	5,288,900	5,256,200	5,267,000	5,267,500
									準備預金残	4,626,500	4,635,000	4,606,400	4,618,000	4,601,500
									マネタリーベース	6,482,500	6,497,500	6,464,800	6,475,600	6,476,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.015%	▲ 0.014%	▲ 0.015%
									コール市場残高	161,544	162,379	164,423	169,392	165,754
									うち無担	140,947	143,637	144,552	147,972	144,010
									うちO/N	84,739	84,879	83,264	85,944	82,242
									うち有担	20,597	18,742	19,871	21,420	21,744

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
流動性供給	334	-	5,000	2021/5/26		21,214.0	4,954.0		▲0.0030%	49.2781%		▲0.0030%		
交付税特会	-	-	11,000	2021/6/2	2021/12/3	436,892.0	10,990.20		0.0000%	2.5156%		0.0000%		10.0

●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/5/26	2021/6/9		3,351	3,351				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/5/25	2021/5/26	▲ 0.350	314	314		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/5/25	2021/5/26	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/5/27	2021/6/4	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/5/27	2021/8/19	0.330	0	0				

●2021年5月26日の予定

- *月例経済報告
- *4月の企業向けサービス価格指数

◆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