

Central Daily Market Report

2021年4月7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4月7日 需給速報	2021年4月8日 需給予想	2021年4月9日 当社予想
銀行券	200	▲ 100	1,000
財政	▲ 6,500	3,900	▲ 23,000
資金過不足	▲ 6,300	3,800	▲ 22,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,700	▲ 4,900	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	20,000		
国債買入		7,600	
CP等買入		▲ 100	▲ 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			
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入	400	200	
国債補完供給	▲ 100	200	100
※ドル資金供給用担保確保供給			
当預増減	10,900	11,600	▲ 22,000
当座預金残高	5,188,500	5,200,100	5,178,100
準備預金残高	4,586,100		
積み終了先	4,586,100		4月8日以降の残り所要積立額
超過準備	4,586,100		積数
非準備預金先	602,400		1日平均
			0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,646,500
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			74.19%

●2021年4月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態の調達姿勢にあまり変化は見られず、引き続き高い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▲0.011~▲0.003%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.05~▲0.005%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散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/8-4/9)は、▲0.085~▲0.070%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2Y414~422、5Y140~146、10Y345~361、20Y170~175、30Y59~69、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、3M物が▲0.089%、1Y物が▲0.127%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日の前倒し発行にあたり、石油・鉄鋼等から大ロットの発行が実施された。500億円弱の償還総額に対して、2,000億円強の発行総額に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2021/4/7	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)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.074	0.095	▲ 0.010	29,730.79	34.16	109.79-80	109.79-80
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.078						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.008				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.040	0.050	▲ 0.025				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.086						
1M	▲ 0.009	▲ 0.006	▲ 0.008				-	▲ 0.094						
3M			0.005				▲ 0.089	▲ 0.099						
6M							▲ 0.099	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136						
									日付	3/31	4/1	4/2	4/5	4/6
									日銀当預残	5,225,700	5,199,800	5,167,000	5,156,800	5,177,600
									準備預金残	4,633,900	4,585,500	4,555,000	4,571,100	4,551,000
									マネタリーベース	6,436,100	6,411,000	6,378,000	6,367,300	6,387,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.014%	▲ 0.012%	▲ 0.010%	▲ 0.010%
									コール市場残高	97,090	152,186	157,457	136,570	138,409
									うち無担	83,339	129,702	134,690	115,207	117,680
									うちO/N	55,796	88,919	90,092	68,314	71,442
									うち有担	13,751	22,484	22,767	21,363	20,729

●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	棄分率	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)	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5年超10年以下)	4,500	2021/4/8			8,577	4,512	▲0.004		▲0.003	73.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2021/4/8			4,492	2,006	▲0.004		▲0.002	47.9
国債買入(物価連動債)	600	2021/4/8			1,821	600		▲0.090	▲0.136	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/4/7	2021/4/8	▲ 0.350	91	91		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/7	2021/4/8	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2021/4/12			2,154	1,252	▲0.080		▲0.065	86.7

●2021年4月8日の予定

*2月の国際収支	*国庫短期証券(985回)入札 (6ヶ月、34,000億円、4/12発行)	*5年利付国債入札 (25,000億円、4/9発行)
*2月の特定サービス産業動態統計速報		
*3月の消費動向調査		
*3月の景気ウォッチャー調査		

◆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