

# Central Daily Market Report

2021年4月9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4月9日		2021年4月12日		2021年4月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	700		600		2,000	
財政	▲ 24,700		▲ 4,900		2,000	
資金過不足	▲ 24,000		▲ 4,300		4,000	
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 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			1,300			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			200			
国債補完供給	▲ 500	100		500		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 24,700		▲ 2,400		4,000	
当座預金残高	5,174,300		5,171,900		5,175,900	
準備預金残高	4,584,400					
積み終了先	4,584,400		4月12日以降の残り所要積立額		0	
超過準備	4,584,400		積数		0	
非準備預金先	589,900		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	87.10%		

## ●2021年4月9日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により一部でビッドレートを引き上げる先が現れたこともあり、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~▲0.002%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.045~▲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(4/12-4/13)は、▲0.080~▲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>

本日はTB3M物(986回)の入札が実施された。WI取引においては▲0.095~▲0.092%の出会いが見られ、平均落札利回▲0.0945%、按分落札利回▲0.0930%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、▲0.100~▲0.099% 出会いとしっかりとした推移となった。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額600億円程度に対し、発行総額1,000億円程度の発行超となった。小売業態から大型発行案件が見られ発行総額を押し上げたものの、案件数は限定的だった。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

2021/4/9	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.078	0.100	0.005	29,768.06	59.08	109.33-34	109.50-51
T/N	▲ 0.007	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.077						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.002	▲ 0.007				-	▲ 0.080						
2W			0.030				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.090						
1M	0.030	0.150	0.083				-	▲ 0.094						
3M	0.020	0.150	0.094				▲ 0.100	▲ 0.099						
6M							▲ 0.110	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.136						
									日付	4/2	4/5	4/6	4/7	4/8
									日銀当預残	5,167,000	5,156,800	5,177,600	5,188,500	5,199,000
									準備預金残	4,555,000	4,571,100	4,551,000	4,586,100	4,596,200
									マネタリーベース	6,378,000	6,367,300	6,387,200	6,397,900	6,408,500
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%
									コール市場残高	157,457	136,570	138,409	150,082	147,880
									うち無担	134,690	115,207	117,680	128,708	127,418
									うちO/N	90,092	68,314	71,442	79,655	77,890
									うち有担	22,767	21,363	20,729	21,374	20,462

## ●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	986	-	65,000	2021/4/12	2021/7/19	202,681.7	52,982.2	100.0250	▲0.0930%	77.2783%	100.0254	▲0.0945%	12,017.0
エネルギー対策	-	-	8,000	2021/4/20	2022/4/20	225,943.0	7,999.79		0.0000%	3.5407%		0.0000%	

## ●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)		2021/4/9	2021/4/12	▲0.350	490	490		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/9	2021/4/12	▲0.350	0	0				

## ●2021年4月12日の予定

\*3月の企業物価指数

\*米国3月の財政収支

◆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