

# Central Daily Market Report

2021年4月22日(木)

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22日		2021年4月23日		2021年4月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 2,000		▲ 2,000	
財政	6,800		20,000		▲ 2,000	
資金過不足	4,700		18,000		▲ 4,000	
<b>金融調節</b>	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	7,500					
国債買入	9,600					
CP等買入		▲ 200		▲ 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				▲ 600	800	
新型コロナ対応金融支援特別			47,200	▲ 27,600		
E T F 買入			200			
国債補完供給	▲ 100	400		100		
<small>※ドル資金供給用担保提供枠</small>						
当預増減	21,900		37,200		▲ 3,200	
当座預金残高	5,270,700		5,307,900		5,304,700	
準備預金残高	4,610,400					
積み終了先	4,609,600		4月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,609,400		積数		3,900	
非準備預金先	660,300		1日平均		200	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,599,500	
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	23.33%		

## ●2021年4月22日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.030~▲0.002%の出会いが始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(4/23-4/26)は、▲0.105~▲0.09%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2Y414~423、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(989回)の入札が実施された。WI取引において▲0.110~▲0.105%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1102%、按分落札利回▲0.1082%と、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは甘めの売り気配も見られたものの、▲0.110%出会いと底堅く推移した。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額700億円程度に対して、発行総額は1,600億円程度と大きく発行超であった。一部の石油業態において大型発行が見られたものの、小型案件を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/4/22	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	
	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.095	0.065	▲ 0.005	29,188.17	679.62	108.04-05	107.90-91
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.111						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W			▲ 0.008				-	▲ 0.110						
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.112						
1M	▲ 0.008	0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.105	▲ 0.112						
6M							▲ 0.110	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.138						
									日付	4/15	4/16	4/19	4/20	4/21
									日銀当預残	5,265,400	5,271,700	5,273,000	5,256,900	5,248,800
									準備預金残	4,629,900	4,621,000	4,627,800	4,595,400	4,587,000
									マネタリーベース	6,474,000	6,480,300	6,482,300	6,466,700	6,459,800
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.013%
									コール市場残高	134,047	159,256	161,230	169,987	171,756
									うち無担	113,386	139,901	140,566	149,902	151,584
									うちO/N	68,803	89,233	87,428	95,844	95,811
									うち有担	20,661	19,355	20,664	20,085	20,172

## ●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	989	-	34,000	2021/4/26	2021/10/25	147,278.0	27,716.4	100.0540	▲0.1082%	34.8783%	100.0550	▲0.1102%	6,283.0

## ●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)		2021/4/22	2021/4/23	▲ 0.350	124	124		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/4/22	2021/4/23	▲ 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)2021/4/23時点の貸出残高(億円)					
新型コロナ対応金融支援特別	2021/4/23	2021/10/28	0	47,193	667,897					

## ●2021年4月23日の予定

*3月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.1%)	*米国3月の新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(990回)入札 (3ヶ月、65,000億円、4/26発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、5/11借入)
---	------------------	---

◆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