

# Central Daily Market Report

2021年3月1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3月1日 需給速報	2021年3月2日 需給予想	2021年3月3日 当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 300	0
財政	▲ 38,200	▲ 17,100	▲ 68,000
資金過不足	▲ 38,400	▲ 17,400	▲ 68,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		4,700	
CP等買入		▲ 400	
貸出支援基金(成)			6,800 ▲ 5,300
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			
国債補完供給	300		
※ドル資金供給用担保確保供給			
当預増減	▲ 38,100	▲ 13,100	▲ 66,500
当座預金残高	4,900,600	4,887,500	4,821,000
準備預金残高	4,327,400		
積み終了先	4,327,000	3月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,327,000	積数	400
非準備預金先	573,200	1日平均	0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			3,263,100
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			50.00%

## ●2021年3月1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▲0.035~▲0.004%の出合いで始まった。都銀業態は引き続き調達ニーズを強める動きとなっている一方で、地銀業態の一部では調達レートを切り下げる動きが見られた。ターム物はオフアワーが少なく、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(3/2-3/3)は、▲0.095~▲0.08%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2Y410~421、5Y136~146、10Y345~361、20Y167~175、30Y59~69、40Y10~13等にビッグの出入りがあった。

### <短国市場>

本日のアウトライイト市場は、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP市場は、入札案件がなく閑散としていた。償還も僅かであったこともあり、月初から積極的な調達をする発行体は見受けられなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/1	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.084	0.150	▲ 0.010	29,663.50	697.49	106.47-49	106.59-61
T/N	▲ 0.023	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.090						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W	▲ 0.040	0.050	▲ 0.006				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.095						
1M	0.010	0.140	0.053				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.110	▲ 0.105						
6M							▲ 0.118	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.137						
									日付	2/19	2/22	2/24	2/25	2/26
									日銀当預残	4,935,500	4,913,800	4,927,800	4,920,200	4,938,700
									準備預金残	4,333,700	4,329,200	4,334,800	4,301,900	4,326,100
									マネタリーベース	6,140,100	6,119,300	6,134,000	6,127,800	6,147,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.022%	▲ 0.022%
									コール市場残高	158,386	150,927	144,490	147,992	159,541
									うち無担	137,797	130,885	124,138	127,433	138,475
									うちO/N	81,924	74,572	75,500	78,975	92,122
									うち有担	20,589	20,042	20,352	20,559	21,066

## ●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1年以下)	1,000	2021/3/2			4,052	1,000	0.007		0.015	49.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/3/2			11,846	3,704	▲0.008		▲0.007	17.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフアワー分)		2021/3/1	2021/3/2	▲ 0.350	11	11		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフアワー分)		2021/3/1	2021/3/2	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年3月2日の予定

*1月の完全失業率(市場予想：3.0%)	*ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値	*10年利付国債入札(26,000億円、3/3発行)
*1月の有効求人倍率(市場予想：1.06倍)		*交付税特別会計借入(10,500億円、3/9借入)
*2月実績/3月見込み財政資金対民間収支		
*2月のマネタリーベース		
*10-12月期の法人企業統計調査季報		

◆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