

Central Daily Market Report

2021年3月2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3月2日 需給速報	2021年3月3日 需給予想	2021年3月4日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 200	0
財政	▲ 17,000	▲ 74,000	3,000
資金過不足	▲ 17,300	▲ 74,200	3,000
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		15,000	
国債買入	4,700		
CP等買入		▲ 400	▲ 100
貸出支援基金(成)		6,800	▲ 4,100
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	▲ 100		100
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>			
当預増減	▲ 13,100	▲ 56,500	3,000
当座預金残高	4,887,500	4,831,000	4,834,000
準備預金残高	4,300,300		
積み終了先	4,300,300		3月3日以降の残り所要積立額
超過準備	4,300,100		積数
非準備預金先	587,200		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
			53.57%

●2021年3月2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▲0.03~▲0.003%の出合いで始まった。都銀・信託業態は引き続き調達ニーズを強めており、一部では地銀業態と同水準の出合いが見られた。ターム物はオファーが少なく、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/3-3/4)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、短国買入オペアが前回と同額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差+0.002%と、やや弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、償還額800億円程度に対し、約400億円の発行が実施された。入札は数件程度にとどまった。発行レートは、積極的な応札により、低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/3/2	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	▲ 0.022				-	▲ 0.083	0.125	▲ 0.025	29,408.17	▲ 255.33	106.84-85	106.84-86
T/N	▲ 0.023	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.009				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.008	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.110	▲ 0.105						
6M							▲ 0.118	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.137						
									日付	2/22	2/24	2/25	2/26	3/1
									日銀当預残	4,913,800	4,927,800	4,920,200	4,938,700	4,900,600
									準備預金残	4,329,200	4,334,800	4,301,900	4,326,100	4,327,200
									マネタリーベース	6,119,300	6,134,000	6,127,800	6,147,200	6,109,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.024%
									コール市場残高	150,927	144,490	147,992	159,541	154,942
									うち無担	130,885	124,138	127,433	138,475	133,791
									うちO/N	74,572	75,500	78,975	92,122	86,088
									うち有担	20,042	20,352	20,559	21,066	21,151

●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)
10年利付国債	361	0.10%	26,000	2021/3/3	2030/12/20	66,625.0	21,221.0	99.6700	0.1340%	30.8194%	99.7000	0.1310%	4,768.0
交付税特会	-	-	10,500	2021/3/9	2021/9/7	354,718.0	10,500.28		0.0000%	2.9602%		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
国庫短期証券買入	15,000	2021/3/3			43,997	15,003	0.002		0.003	43.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/2	2021/3/3	▲ 0.350	72	72		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/2	2021/3/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/3/4	2021/3/11	0.320	1	1				
米ドル資金供給		2021/3/4	2021/5/27	0.330	0	0				

●2021年3月3日の予定

*片岡日銀審議委員、群馬県金融経済懇談会において講演
*3月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国ページブック
*米国2月のISM非製造業景況指数

◆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