

# Central Daily Market Report

2021年3月4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3月4日 需給速報	2021年3月5日 需給予想	2021年3月8日 当社予想			
銀行券	▲ 400	200	1,000			
財政	600	▲ 6,300	4,000			
資金過不足	200	▲ 6,100	5,000			
<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						
国債買入						
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				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	400		200		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	300	▲ 6,100				5,000
当座預金残高	4,830,100	4,824,000				4,829,000
準備預金残高	4,255,900					
積み終了先	4,255,900		3月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,255,900		積数	200		
非準備預金先	574,200		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	60.71%		

## ●2021年3月4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▲0.025~▲0.003%の出会いで始まった。積み期間後半となり、全般的に調達ニーズがしっかりと出てきたことで加重平均レートは上昇した。ターム物はオファーが少ない中、ショートターム物で引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(3/5-3/8)は、▲0.085~▲0.07%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、WI取引において明日入札の3M物が▲0.103%で出合ったものの、全体的には閑散なマーケットとなった。

### <CP市場>

CP市場は、償還額600億円強に対して、発行は少額案件が数件実施されるにとどまったことから200億円弱となった。発行レートは、低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/4	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	
	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.080	0.135	0.020	28,930.11	▲ 628.99	107.07-08	107.15-16
T/N	▲ 0.018	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.080						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W	▲ 0.009	▲ 0.007	▲ 0.009				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.110	▲ 0.107						
6M							▲ 0.118	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.137						
									日付	2/25	2/26	3/1	3/2	3/3
									日銀当預残	4,920,200	4,938,700	4,900,600	4,887,500	4,829,800
									準備預金残	4,301,900	4,326,100	4,327,200	4,301,000	4,252,100
									マネタリーベース	6,127,800	6,147,200	6,109,200	6,096,400	6,038,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.024%	▲ 0.022%	▲ 0.020%
									コール市場残高	147,992	159,541	154,942	138,252	138,886
									うち無担	127,433	138,475	133,791	117,470	117,550
									うちO/N	78,975	92,122	86,088	70,187	70,267
									うち有担	20,559	21,066	21,151	20,782	21,336

## ●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)
30年利付国債	69	0.70%	9,000	2021/3/5	2050/12/20	20,374.0	7,366.0	100.0000	0.7000%	29.9498%	100.2200	0.6910%	1,621.0
交付税特会	-	-	10,500	2021/3/12	2021/9/10	371,833.0	10,500.50		0.0000%	2.8240%		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)		2021/3/4	2021/3/5	▲ 0.350	202	202		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/4	2021/3/5	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年3月5日の予定

*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*米国1月の貿易収支 *米国1月の消費者信用残高 *米国2月の雇用統計	*国庫短期証券(977回)入札 (3ヶ月、67,000億円、3/8発行)
----------------------	---	---

◆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