

Central Daily Market Report

2021年3月5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3月5日		2021年3月8日		2021年3月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		300		0	
財政	▲ 7,200		3,300		2,000	
資金過不足	▲ 6,900		3,600		2,000	
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						
貸出支援基金(成)						
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						
ETF買入						
国債補完供給						
*ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 7,000		15,700		2,000	
当座預金残高	4,823,100		4,838,800		4,840,800	
準備預金残高	4,266,600					
積み終了先	4,266,600		3月8日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,266,600		積数		100	
非準備預金先	556,500		1日平均		0	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,267,500	
準備預金進捗率					実績	100.00%
					日数	71.43%

●2021年3月5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▲0.020~▲0.005%の出合いで始まった。積み期後半に入り、マクロ加算残高に余裕がある先からの調達ニーズが高まっていることに加えて週末の3日積み要因もあって、取り上がる動きが強く、前日比でレートが上昇した。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(3/8-3/9)は、▲0.08~▲0.07%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>

本日はTB3M物(977回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.105~▲0.103%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1035%、按分落札利回▲0.1005%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、▲0.110%出合いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、複数の発行体から調達を実施されたものの、大型案件はなく、発行総額は600億円にとどまった。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

2021/3/5	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.076	0.085	▲ 0.050	28,864.32	▲ 65.79	107.94-96	108.26-27
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.076						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.083						
2W							-	▲ 0.088						
3W	0.030	0.050	0.034				-	▲ 0.093						
1M			0.150				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.105	▲ 0.107						
6M							▲ 0.118	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.137						

●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	977	-	67,000	2021/3/8	2021/6/14	172,512.2	54,619.2	100.0270	▲0.1005%	85.6856%	100.0278	▲0.1035%	12,380.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万円)	スタート日	エンド日	実行利率	応札総額(億円・百万円)	落札総額(億円・百万円)	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年超3年以下)	4,000	2021/3/8			8,663	4,002	0.000		0.002	55.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/3/8			10,810	3,707	0.004		0.005	86.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/3/8			8,391	4,204	0.008		0.011	71.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/5	2021/3/8	▲ 0.350	73	73		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/5	2021/3/8	▲ 0.350	0	0				

●2021年3月8日の予定

- *1月の国際収支
- *1月の景気動向指数速報
- *2月の景気ウォッチャー調査

*米国1月の卸売売上高

◆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