

Central Daily Market Report

2021年3月8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8日 需給速報	2021年3月9日 需給予想	2021年3月10日 当社予想
銀行券	300	500	0
財政	700	6,700	▲29,000
資金過不足	1,000	7,200	▲29,000
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			▲4,000
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	12,100		
CP等買入		▲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			
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
ETF買入			
国債補充供給	▲500	100	500
*ドル資金供給用担保提供枠			
当預増減	12,600	7,600	▲33,000
当座預金残高	4,835,700	4,843,300	4,810,300
準備預金残高	4,294,800		
積み終了先	4,294,700		3月9日以降の残り所要積立額
超過準備	4,294,700		積数 100
非準備預金先	540,900		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 75.00%	

●2021年3月8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▲0.025~▲0.005%での調達で始まった。引き続き調達意欲は強く、一巡後も▲0.02%近辺での出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/9-3/10)は、▲0.075~▲0.065%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、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発行市場は、償還総額1,300億円程度に対して、発行総額2,400億円程度に膨らんだ。電機・機械等からは月内物で大口の発行が見られた。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

2021/3/8	無担(速報)			有担(速報)			短期 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)	為替(17時)
O/N	▲0.075	0.001	▲0.014				-	▲0.069	0.110	0.025	28,743.25	▲121.07	108.39-41	108.50-51	
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.004				-	▲0.071							
S/N			▲0.010				-	-							
1W	▲0.020	▲0.009	▲0.014				-	▲0.079							
2W							-	▲0.087							
3W			▲0.005				-	▲0.091							
1M							-	▲0.103							
3M							-	▲0.105							
6M							-	▲0.115							
1Y							-	▲0.135							
										日付	3/1	3/2	3/3	3/4	3/5
										日銀当預残	4,900,600	4,887,500	4,829,800	4,830,100	4,823,100
										準備預金残	4,327,200	4,301,000	4,252,100	4,256,200	4,267,900
										マネタリーベース	6,109,200	6,096,400	6,038,800	6,039,500	6,032,200
										無担O/N加重平均	▲0.024%	▲0.022%	▲0.020%	▲0.016%	▲0.014%
										コール市場残高	154,942	138,252	138,886	134,115	141,861
										うち無担	133,791	117,470	117,550	112,629	120,859
										うちO/N	86,088	70,187	70,267	64,686	66,566
										うち有担	21,151	20,782	21,336	21,486	21,002

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/8	2021/3/9	▲0.350	467	467		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/8	2021/3/9	▲0.350	0	0				

●2021年3月9日の予定

*10-12月期のGDP2次速報 (市場予想:前期比年率+12.8%)	*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値	*国庫短期証券(978回)入札 (6ヶ月、34,000億円、3/10発行)
*1月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲2.1%)		*5年利付国債入札 (25,000億円、3/10発行)
*1月の毎月勤労統計調査速報		
*2月のマネーストック		

◆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いますが、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