

# Central Daily Market Report

2021年3月9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9日 需給速報	2021年3月10日 需給予想	2021年3月11日 当社予想
銀行券	600	400	0
財政	8,600	▲ 29,500	4,000
資金過不足	9,200	▲ 29,100	4,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			3,600 ▲ 4,000
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲ 100	▲ 300
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			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 500	500	500
※ドル資金供給用担保提供			
当増減	9,100	▲ 29,300	4,000
当座預金残高	4,844,800	4,815,500	4,819,500
準備預金残高	4,285,800		
積み終了先	4,285,800		3月10日以降の残り所要積立額
超過準備	4,285,800		積数 100
非準備預金先	559,000		1日平均 0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			3,267,400
準備預金進捗率	実績 100.00%	日数 78.57%	

## ●2021年3月9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。引き続き強めの地合いに変化はなく、一巡後も朝方と同水準のレート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。共通担保資金供給オペは20,000億円(3/10~3/24)オファーされ、応札額3,551億円(期落ち分3,951億円)と札割れとなった。

### <レポ市場>

GCT/N(3/10~3/11)は、▲0.070~▲0.060%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TB6M物(978回)の入札が実施され、WI取引において、▲0.103%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1070%、按分落札利回▲0.1030%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、▲0.113~▲0.110%出合いと、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,900億円弱であったが、小口の案件が散見された程度であり、発行総額は300億円強にとどまった。レート水準に目立った変化は見られていない。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/9	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買差	前日比	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.066	0.125	0.015	29,027.94	284.69	108.92~94	108.80~81
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.065						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.015	0.150	0.072				-	▲ 0.075						
2W			▲ 0.006				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.090						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.100	▲ 0.105						
6M							▲ 0.113	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	3/2	3/3	3/4	3/5	3/8
									日銀当預残	4,887,500	4,829,800	4,830,100	4,823,100	4,835,700
									準備預金残	4,301,000	4,252,100	4,256,200	4,267,900	4,294,800
									マネタリーベース	6,096,400	6,038,800	6,039,500	6,032,200	6,044,400
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.020%	▲0.016%	▲0.014%	▲0.014%
									コール市場残高	138,252	138,886	134,115	141,861	136,569
									うち無担	117,470	117,550	112,629	120,859	116,037
									うちO/N	70,187	70,267	64,686	66,566	60,794
									うち有担	20,782	21,336	21,486	21,002	20,532

## ●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	978	-	34,000	2021/3/10	2021/9/10	138,939.0	27,716.40	100.0520	▲0.1030%	57.8540%	100.0540	▲0.1070%	6,283.0
5年利付国債	146	0.10%	25,000	2021/3/10	2025/12/20	66,855.0	20,568.0	100.7400	▲0.0540%	18.1264%	100.7800	▲0.0620%	4,428.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/3/10	2021/3/24		3,551	3,551				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/9	2021/3/10	▲ 0.350	512	512		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/9	2021/3/10	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/3/11	2021/3/18	0.320	0	0				
米ドル資金供給		2021/3/11	2021/6/4	0.320	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	2,000	2021/3/12			2,475	2,001	▲ 0.093		▲ 0.085	45.4

## ●2021年3月10日の予定

*1月の特定サービス産業動態統計速報	*米国2月の財政収支
	*米国2月の消費者物価指数

◆本資料は信頼できるとさ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