

# Central Daily Market Report

2021年3月10日(水)  
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10日		2021年3月11日		2021年3月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 31,100		▲ 300		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 30,700		▲ 400		▲ 13,000	
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	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		▲ 300		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						2,000
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 200	500		200		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 31,100		▲ 900		▲ 11,000	
当座預金残高	4,813,700		4,812,800		4,801,800	
準備預金残高	4,248,400					
積み終了先	4,248,300		3月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,248,300		積数		0	
非準備預金先	565,300		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	82.14%		

## ●2021年3月10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。引き続き調達ニーズは強く、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。

### <レポ市場>

GC T/N(3/11~3/12)は、▲0.065~▲0.060%程度での出合い。SCはローラー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、1Y物が▲0.137~▲0.135%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額2,000億円弱に対して、発行総額は1,600億円程度であった。発行件数は少なかったが、陸運・機械から大口の発行が見られ、発行総額を押し上げた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/10	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.063	0.120	▲ 0.005	29,036.56	8.62	108.57-59	108.72-74
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.064						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.008				-	▲ 0.074						
2W							-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.099	▲ 0.105						
6M							▲ 0.113	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	3/3	3/4	3/5	3/8	3/9
									日銀当預残	4,829,800	4,830,100	4,823,100	4,835,700	4,844,800
									準備預金残	4,252,100	4,256,200	4,267,900	4,294,800	4,286,900
									マネタリーベース	6,038,800	6,039,500	6,032,200	6,044,400	6,053,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.016%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.013%
									コール市場残高	138,886	134,115	141,861	136,569	126,011
									うち無担	117,550	112,629	120,859	116,037	104,418
									うちO/N	70,267	64,686	66,566	60,794	57,675
									うち有担	21,336	21,486	21,002	20,532	21,593

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/10	2021/3/11	▲ 0.350	183	183		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/10	2021/3/11	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年3月11日の予定

*東日本大震災から10年 *2月の企業物価指数	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*20年利付国債入札 (12,000億円、3/12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