

Central Daily Market Report

2021年3月11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11日 需給速報	2021年3月12日 需給予想	2021年3月15日 当社予想
銀行券	▲ 100	100	0
財政	100	▲ 13,600	3,000
資金過不足	0	▲ 13,500	3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		20,000	
国債買入			
CP等買入		▲ 800	▲ 700
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	200	200
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 700	8,000	3,000
当座預金残高	4,813,000	4,821,000	4,824,000
準備預金残高	4,270,000		
積み終了先	4,270,000		3月12日以降の残り所要積立額
超過準備	4,269,900		積数
非準備預金先	543,000		1日平均
			0
			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
			85.71%

●2021年3月11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▲0.02~▲0.005%での調達で始まった。積み最終日を2営業日後に控え、着地に向けた調達ニーズは強く、一部の業態では調達レートを切り上げる動きが見られた。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(3/12~3/15)は、▲0.085~▲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>

本日のアウトライイト市場は、短国買入オペアが前回から5,000億円増額の20,000億円でおファーされた。平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差+0.001%と、無難な結果となった。マーケットでは、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、五・十日発行にあたり、建設・石油業態等から大型発行が実施された。償還総額3,000億円強に対して、発行総額2,700億円弱とやや償還超となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移したが、3月中に償還を迎える銘柄では若干レートが上昇する傾向が見られた。

●短期金融市場関連指標

2021/3/11	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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)
単位：%									0.100	▲ 0.020	29,211.64	175.08	108.44-45	108.66-67
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.064						
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.080						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W			▲ 0.009				-	▲ 0.082						
2W			0.001				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.101						
1M			0.018				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.099	▲ 0.104						
6M							▲ 0.115	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	3/4	3/5	3/8	3/9	3/10
									日銀当預残	4,830,100	4,823,100	4,835,700	4,844,800	4,813,700
									準備預金残	4,256,200	4,267,900	4,294,800	4,286,900	4,248,900
									マネタリーベース	6,039,500	6,032,200	6,044,400	6,053,000	6,021,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.013%
									コール市場残高	134,115	141,861	136,569	126,011	139,385
									うち無担	112,629	120,859	116,037	104,418	117,628
									うちO/N	64,686	66,566	60,794	57,675	69,735
									うち有担	21,486	21,002	20,532	21,593	21,757

●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)
20年利付国債	175	0.50%	12,000	2021/3/12	2040/12/20	33,007.0	9,706.00	99.6500	0.5190%	33.1567%	99.7500	0.5130%	2,283.0

●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
国庫短期証券買入	20,000	2021/3/12			40,537	20,005	0.001		0.002	18.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/11	2021/3/12	▲ 0.350	241	241		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/11	2021/3/12	▲ 0.350	0	0				

●2021年3月12日の予定

*1-3月期の法人企業景気予測調査季報	*米国2月の生産者物価指数	*国庫短期証券(979回)入札(3ヶ月、67,000億円、3/15発行)
	*米国3月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*エネルギー対策借入(6,500億円、3/22借入)

◆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