Central Daily Market Report

2021年3月12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12日 需給速報		2021年3月15日 需給予想		2021年3月16日 当社予想	
銀行券	100		600		0	
財政	▲ 14,400		3,900		4,000	
資金過不足	▲ 14,300		4,500		4,000	
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	20,000					
国債買入			9,700			
CP等買入		▲ 700		▲ 1,200		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 900	200		900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	6,300		13,900		4,000	

当座預金残高	4,819,300	4,833,200	4,837,200
準備預金残高	4,269,800		
積み終了先	4,269,800		
超過準備	4,269,800		
非準備預金先	549,500		

3月15日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 96.43%

●2021年3月12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▲0.015～▲0.003%での調達で始まった。積み最終日の前営業日であることに加え、週末要因も重なったためレート水準が上昇した。一巡後は▲0.01%近辺の出合いが数件見られる程度で、今週の取引を終えた。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>

GCT/N(3/15-3/16)は、▲0.060～▲0.040%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(979回)の入札が実施され、WI取引において、▲0.096～▲0.094%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0964%、按分落札利回▲0.0930%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、▲0.104%出合いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額600億円程度に対して、発行総額1,300億円程度の発行超となった。発行案件は少なかったものの、小売・食料品業態から大口の発行が見られた。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/3/12	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.013				－	▲ 0.056
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.054
S/N			▲ 0.008				－	－
1W	▲ 0.010	0.030	0.000				－	▲ 0.074
2W			▲ 0.020				－	▲ 0.082
3W							－	▲ 0.101
1M			▲ 0.015				－	▲ 0.103
3M							▲ 0.105	▲ 0.104
6M							▲ 0.116	▲ 0.112
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.110	0.010	29,717.83	506.19	108.57-58	109.03-05

日付	3/5	3/8	3/9	3/10	3/11
日銀当預残	4,823,100	4,835,700	4,844,800	4,813,700	4,813,000
準備預金残	4,267,900	4,294,800	4,286,900	4,248,900	4,270,300
マネタリーベース	6,032,200	6,044,400	6,053,000	6,021,500	6,020,800
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.012%
コール市場残高	141,861	136,569	126,011	139,385	142,822
うち無担	120,859	116,037	104,418	117,628	121,483
うちO/N	66,566	60,794	57,675	69,735	74,190
うち有担	21,002	20,532	21,593	21,757	21,339

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	979	－	67,000	2021/3/15	2021/6/21	178,980.4	54,614.5	100.0250	▲0.0930%	6.4259%	100.0259	▲0.0964%	12,385.0
エネルギー対策	－	－	6,500	2021/3/22	2022/3/22	174,254.0	6,499.94		0.0000%	3.7303%		0.0000%	

●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
国債買入（残存期間1年以下）	1,000	2021/3/15			2,521	1,004	0.003		0.006	70.9
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,000	2021/3/15			8,009	4,003	▲0.010		▲0.004	11.6
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,200	2021/3/15			6,880	4,204	▲0.005		0.000	2.2
国債買入（残存期間25年超）	300	2021/3/15			1,481	303	▲0.017		▲0.015	40.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/3/12	2021/3/15	▲ 0.350	865	865		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/3/12	2021/3/15	▲ 0.350	38	38		▲0.350	▲0.350	

●2021年3月15日の予定

*1月の機械受注統計（市場予想：電力除く民需、前月比▲5.5%）
*1月の第3次産業活動指数

◆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。
◆本資料は何ら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論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