

Central Daily Market Report

2021年3月15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15日 需給速報	2021年3月16日 需給予想	2021年3月17日 当社予想
銀行券	700	300	0
財政	1,000	2,900	▲ 2,000
資金過不足	1,700	3,200	▲ 2,000
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			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	9,700		
CP等買入		▲ 1,200	▲ 300
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			64,500 ▲ 63,400
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	▲ 900	900	900
*ドル資金供給用担保確保供給			
当増減	10,200	3,800	▲ 900
当座預金残高	4,829,500	4,833,300	4,832,400
準備預金残高	4,258,200		
積み終了先	4,258,200	3月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,258,200	積数	3,631,700
非準備預金先	571,300	1日平均	117,200
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,631,700
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数
			0.00%

●2021年3月15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▲0.020~▲0.005%での調達で始まった。ビッドサイドはしっかりしているものの、先週末で調達を終えている先も見られ、積み最終日としては落ち着いた展開となった。一巡後は調整の合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/16-3/17)は、▲0.080~▲0.075%程度での合い。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2Y410~422、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、3M物が▲0.105%、6M物が▲0.120%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,700億円程度に対して、発行総額は50億円程度と大きく償還超であった。発行案件少なく閑散なマーケットであった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。CP等買入オペは6,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.027%・按分レート▲0.045%と、前回(平均▲0.031%・按分▲0.036%)比で平均レートは上昇し、按分レートは低下した。

●短期金融市場関連指標

2021/3/15	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	
	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.067	0.105	▲ 0.005	29,766.97	49.14	109.11-12	109.18-19
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.009	▲ 0.008	▲ 0.008				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.101						
1M			0.000				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.105	▲ 0.106						
6M							▲ 0.120	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.137						
									日付	3/8	3/9	3/10	3/11	3/12
									日銀当預残	4,835,700	4,844,800	4,813,700	4,813,000	4,819,300
									準備預金残	4,294,800	4,286,900	4,248,900	4,270,300	4,269,800
									マネタリーベース	6,044,400	6,053,000	6,021,500	6,020,800	6,027,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.013%
									コール市場残高	136,569	126,011	139,385	142,822	142,202
									うち無担	116,037	104,418	117,628	121,483	121,466
									うちO/N	60,794	57,675	69,735	74,190	66,403
									うち有担	20,532	21,593	21,757	21,339	20,736

●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	案分率	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
CP等買入	6,000	2021/3/18			6,507	5,997	▲0.045		▲0.027	87.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/15	2021/3/16	▲ 0.350	904	904		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/15	2021/3/16	▲ 0.350	10	10		▲ 0.350	▲ 0.350	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2021/3/17	2025/3/17	0	64,498					

●2021年3月16日の予定

*黒田日銀総裁、FIN/SUM(フィンサム)2021において講演	*米国FOMC(1日目) *米国1月の企業在庫 *米国2月の小売売上高 *米国2月の鉱工業生産・設備稼働率	*流動性供給入札(5,000億円、3/17発行)
----------------------------------	--	--------------------------

◆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