

●資金需給

単位：億円	2021年3月16日		2021年3月17日		2021年3月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 200		▲ 1,000	
財政	2,400		▲ 5,000		6,000	
資金過不足	2,700		▲ 5,200		5,000	
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			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 700		6,000
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			64,500	▲ 57,800		
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						
国債補充供給	▲ 400	900		400		
米ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	2,900		11,200		11,000	
当座預金残高	4,832,400		4,843,600		4,854,600	
準備預金残高	4,262,300					
積み終了先	2,902,200					
超過準備	1,158,100					
非準備預金先	570,100					
			3月17日以降の残り所要積立額			
			積数	527,500		
			1日平均	17,600		
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	85.48%	日数	3.23%		

●2021年3月16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▲0.030～▲0.008%での調達で始まった。ビッドサイドの調達ニーズが強く、積み初日としては高水準の出合いとなった。一巡後は調整の出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期内のショートターム物で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GCT/N(3/17-3/18)は、▲0.085～▲0.080%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2Y410～422、5Y136～146、10Y345～361、20Y167～175、30Y59～69、40Y10～13等にビッドの出入りがあつた。

＜短国市場＞

本日のアウトライト市場は、短国買入オペが前回から10,000億円減額分の10,000億円程度でオフアされた。平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差+0.002%と、無難な結果となった。マーケットでは明日入札のTB1Y物(980回)が、WI取引において▲0.125～▲0.123%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1,750億円程度に対して、発行総額は700億円程度と償還超であった。小型案件を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/3/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲0.060	0.001	▲0.019				-	▲0.081	0.095	▲0.010	29,921.09	154.12	109.12-14	109.25-26
T/N	▲0.024	▲0.001	▲0.006				-	▲0.085						
S/N			▲0.011				-	-						
1W	▲0.017	0.040	▲0.005				-	▲0.087						
2W	▲0.020	▲0.015	▲0.018				-	▲0.089						
3W							-	▲0.102						
1M							-	▲0.104						
3M							▲0.105	▲0.106						
6M							▲0.120	▲0.112						
1Y							▲0.130	▲0.137						
									日付	3/9	3/10	3/11	3/12	3/15
									日銀当預残	4,844,800	4,813,700	4,813,000	4,819,300	4,829,500
									準備預金残	4,286,900	4,248,900	4,270,300	4,269,800	4,258,800
									マネタリーベース	6,053,000	6,021,500	6,020,800	6,027,100	6,036,600
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.013%	▲0.012%	▲0.013%	▲0.016%
									コール市場残高	126,011	139,385	142,822	142,202	129,743
									うち無担	104,418	117,628	121,483	121,466	109,614
									うちO/N	57,675	69,735	74,190	66,403	61,216
									うち有担	21,593	21,757	21,339	20,736	20,129

●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)
流動性供給	329	-	5,000	2021/3/17		18,254.0	4,982.0		▲0.0070%	67.5905%		▲0.0080%	

●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	買付利率	応募総額(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	10,000	2021/3/17			28,681	10,004	0.002		0.002	61.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/16	2021/3/17	▲0.350	383	383		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/16	2021/3/17	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/3/18	2021/3/25	0.320	2	2				
米ドル資金供給		2021/3/18	2021/6/10	0.320	0	0				

●2021年3月17日の予定

*10-12月期の資金循環統計速報	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(980回)入札(1年、35,000億円、3/22発行)
*2月の貿易統計	*米国FRB経済見通し発表	
	*米国2月の住宅着工件数	
	*ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値	

◆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。