

# Central Daily Market Report

2021年3月17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17日		2021年3月18日		2021年3月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 400		▲ 1,000	
財政	▲ 4,600		9,200		20,000	
資金過不足	▲ 4,700		8,800		19,000	
<b>金融調節</b>	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			13,400			
CP等買入		▲ 700	6,000	▲ 400		
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						
国債補完供給	▲ 300	400		300		
<small>※ドル資金供給用担保債供給</small>						
<b>当増減</b>	11,400		28,100		19,000	
当座預金残高	4,843,800		4,871,900		4,890,900	
準備預金残高	4,270,500					
積み終了先	4,196,700		3月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,799,000		積数		56,000	
非準備預金先	573,300		1日平均		1,900	
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	98.46%	日数	6.45%		

## ●2021年3月17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~▲0.005%での調達で始まった。一巡後は調整の出会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>

GC T/N(3/18-3/19)は、▲0.080~▲0.075%程度での出会い。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>

本日はTB1Y物(980回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.130%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1298%、按分落札利回▲0.1288%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは出会いは見られなかったものの、▲0.140%近辺での推移となった。

### <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2,200億円程度に対して、発行総額は1,050億円程度と償還超であった。一部の機械業態において大型発行が見られたものの、小型案件を中心とする比較的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

2021/3/17	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	
	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)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.081	0.090	▲ 0.005	29,914.33	▲ 6.76	109.02-03	109.15-17
T/N	▲ 0.013	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.082						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.009	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.005	0.010	▲ 0.003				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.105	▲ 0.106						
6M							▲ 0.125	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.137						
									日付	3/10	3/11	3/12	3/15	3/16
									日銀当預残	4,813,700	4,813,000	4,819,300	4,829,500	4,832,400
									準備預金残	4,248,900	4,270,300	4,269,800	4,258,800	4,262,900
									マネタリーベース	6,021,500	6,020,800	6,027,100	6,036,600	6,039,200
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.012%	▲0.013%	▲0.016%	▲0.019%
									コール市場残高	139,385	142,822	142,202	129,743	149,291
									うち無担	117,628	121,483	121,466	109,614	129,036
									うちO/N	69,735	74,190	66,403	61,216	81,048
									うち有担	21,757	21,339	20,736	20,129	20,255

## ●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)
国庫短期証券	980	-	35,000	2021/3/22	2022/3/22	98,021.0	28,536.8	100.1290	▲0.1288%	56.6320%	100.1300	▲0.1298%	6,463.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/3/18			10,075	4,008	0.000		0.003	13.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/3/18			10,888	3,706	0.000		0.001	18.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/3/18			10,136	4,205	▲0.006		▲0.004	20.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2021/3/18			3,027	1,202	0.005		0.007	19.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/17	2021/3/18	▲0.350	283	283		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/17	2021/3/18	▲0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第9回	2021/3/19	2023/2/17	0

## ●2021年3月18日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)

\*英中銀MPC結果発表

\*国庫短期証券(981回)入札(3ヶ月、67,000億円、3/22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