

# Central Daily Market Report

2021年3月22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22日 需給速報	2021年3月23日 需給予想	2021年3月24日 当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 100	▲ 1,000
財政	82,900	700	2,000
資金過不足	82,700	600	1,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
	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			▲ 3,600
国債売現			
国庫短期証買入		15,000	
国債買入		12,300	
CP等買入	▲ 1,000	▲ 100	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
ETF買入	400	200	
国債補完供給	▲ 2,700	1,200	2,700
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	80,600	30,700	▲ 2,600
当座預金残高	4,966,300	4,997,000	4,994,400
準備預金残高	4,384,800		
積み終了先	4,384,300		3月23日以降の残り所要積立額
超過準備	4,383,900		積数 6,000
非準備預金先	581,500		1日平均 300
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 99.83%	日数 22.58%	

## ●2021年3月22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▲0.03~▲0.003%での調達で始まった。週末要因の剥落等から出会いレートは若干低下したものの、引き続き調達ニーズは強く堅調に推移した。一巡後は▲0.03~▲0.015%の出会いが見られ、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(3/23-3/24)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。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、5Y140~146、10Y345~361、20Y170~175、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、短国買入オペアが前回から5000億円増額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+0.003%と、在庫調整の売りからか、弱めの結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は小売業態においてまとまった発行が実施された。償還総額550億円程度に対して、発行総額は900億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/22	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	▲ 0.014				-	▲ 0.076	0.075	▲ 0.035	29,174.15	▲ 617.90	108.87-89	108.68-69
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.008	0.040	0.005				-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.106	▲ 0.105						
6M							▲ 0.125	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.139						
									日付	3/15	3/16	3/17	3/18	3/19
									日銀当預残	4,829,500	4,832,400	4,843,800	4,869,100	4,885,700
									準備預金残	4,258,800	4,262,900	4,270,500	4,301,300	4,313,400
									マネタリーベース	6,036,600	6,039,200	6,050,800	6,076,600	6,093,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.019%	▲ 0.018%	▲ 0.014%	▲ 0.010%
									コール市場残高	129,743	149,291	139,639	139,144	145,708
									うち無担	109,614	129,036	118,800	118,470	123,497
									うちO/N	61,216	81,048	64,907	66,147	65,154
									うち有担	20,129	20,255	20,839	20,674	22,211

## ●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
国庫短期証券買入	15,000	2021/3/23			54,992	15,009	0.003		0.005	37.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/3/23			8,181	4,002	▲ 0.012		▲ 0.011	91.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/3/23			7,704	3,705	▲ 0.023		▲ 0.021	68.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/3/23			10,559	4,201	▲ 0.036		▲ 0.031	35.9
国債買入(物価連動債)	300	2021/3/23			1,611	300		▲ 0.140	▲ 0.155	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/22	2021/3/23	▲ 0.350	2,662	2,662		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/22	2021/3/23	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超6年以下)	750	2021/3/25			1,618	750	0.008		0.019	47.3

## ●2021年3月23日の予定

*月例経済報告	*米国2月の新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札 (4,000億円、3/24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