Central Daily Market Report

2021年3月23日（火）
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23日 需給速報	2021年3月24日 需給予想	2021年3月25日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 300	▲ 2,000
財政	2,100	▲ 1,400	32,000
資金過不足	1,800	▲ 1,700	30,000

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			4,900	▲ 3,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	15,000					
国債買入	12,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					800	
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 99,900
ＥＴＦ買入	200					
国債補完供給	▲ 2,500	2,700		2,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	29,400		1,400		▲ 69,100	

当座預金残高	4,995,700	4,997,100	4,928,000
準備預金残高	4,399,700		
積み終了先	4,399,200	3月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,399,200	積数	5,600
非準備預金先	596,000	1日平均	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	99.85%	日数	25.81%

●2021年3月23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▲0.02～▲0.002%での調達で始まった。前日比でレート水準に大きな変化はなく、一巡後は▲0.03～▲0.01%近辺で散発的な出合いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で出合いが散見された。

<レポ市場>

GCT/N(3/24-3/25)は、▲0.100～▲0.090%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、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、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は不動産、電気・ガス、陸運業態において大型発行が実施された。償還総額4,000億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と償還超となった。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

2021/3/23	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.014				－	▲ 0.086
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.093
S/N			▲ 0.010				－	－
1W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.008				－	▲ 0.092
2W							－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.105
1M			0.010				－	▲ 0.106
3M			0.070				▲ 0.106	▲ 0.107
6M							▲ 0.120	▲ 0.117
1Y							▲ 0.132	▲ 0.139

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)
0.075	0.000	28,995.92	▲ 178.23	108.77-79	108.76-77

日付	3/16	3/17	3/18	3/19	3/22
日銀当預残	4,832,400	4,843,800	4,869,100	4,885,700	4,966,300
準備預金残	4,262,900	4,270,500	4,301,300	4,313,400	4,378,500
マネタリーベース	6,039,200	6,050,800	6,076,600	6,093,400	6,174,200
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.018%	▲0.014%	▲0.010%	▲0.014%
コール市場残高	149,291	139,639	139,144	145,708	160,809
うち無担	129,036	118,800	118,470	123,497	134,987
うちO/N	81,048	64,907	66,147	65,154	76,359
うち有担	20,255	20,839	20,674	22,211	25,822

●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)
流動性供給	330	－	4,000	2021/3/24		15,961.0	3,991.0		▲0.0020%	73.4497%		▲0.0030%	

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2021/3/24	2021/4/7		4,851	4,851				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2021/3/23	2021/3/24	▲ 0.350	2,470	2,470		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/3/23	2021/3/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/3/25	2021/4/1	0.310	0	0				
米ドル資金供給		2021/3/25	2021/6/17	0.310	0	0				

●2021年3月24日の予定

*金融政策決定会合議事要旨（1月20、21日分）
*2月の企業向けサービス価格指数
*米国2月の耐久財新規受注
*英国2月の消費者物価指数
*国庫短期証券（982回）入札
（6ヶ月、34,000億円、3/25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