

Central Daily Market Report

2021年3月24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24日		2021年3月25日		2021年3月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	100		24,400		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 400		23,000		▲ 14,000	
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 700		▲ 600		
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			186,700	▲ 99,900		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 2,400	2,500		2,400		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	300		112,400		▲ 14,000	
当座預金残高	4,996,000		5,108,400		5,094,400	
準備預金残高	4,392,000					
積み終了先	4,391,900		3月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,391,600		積数	5,200		
非準備預金先	604,000		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	99.86%	日数	29.03%		

●2021年3月24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▲0.025~▲0.002%での調達で始まり、昨日対比で横ばい圏の動きとなった。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>

GC T/N(3/25-3/26)は、▲0.100~▲0.090%程度での出合い。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、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>

本日はTB6M物(982回)の入札が実施され、WI取引において、▲0.107~▲0.106%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1117%、按分落札利回▲0.1098%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、▲0.115%出合いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は機械、卸売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950億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

2021/3/24	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.092	0.065	▲ 0.010	28,405.52	▲ 590.40	108.52-53	108.60-61
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.096						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.106						
2W							-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.106	▲ 0.108						
6M							▲ 0.115	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.132	▲ 0.139						
									日付	3/17	3/18	3/19	3/22	3/23
									日銀当預残	4,843,800	4,869,100	4,885,700	4,966,300	4,995,700
									準備預金残	4,270,500	4,301,300	4,313,400	4,378,500	4,399,700
									マネタリーベース	6,050,800	6,076,600	6,093,400	6,174,200	6,203,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.014%	▲ 0.010%	▲ 0.014%	▲ 0.014%
									コール市場残高	139,639	139,144	145,708	160,809	160,402
									うち無担	118,800	118,470	123,497	134,987	135,810
									うちO/N	64,907	66,147	65,154	76,359	76,782
									うち有担	20,839	20,674	22,211	25,822	24,592

●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	982	-	34,000	2021/3/25	2021/9/27	106,658.0	27,788.6	100.0560	▲0.1098%	98.2904%	100.0570	▲0.1117%	6,211.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/24	2021/3/25	▲ 0.350	2,324	2,324		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/24	2021/3/25	▲ 0.350	3	3		▲ 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)	(参考)2021/3/25時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2021/3/25	2021/9/22	0	186,686	648,264

●2021年3月25日の予定

*米国10-12月期のGDP確報値

*40年利付国債入札(5,000億円、3/26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