Central Daily Market Report

2021年3月25日（木）
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25日 需給速報		2021年3月26日 需給予想		2021年3月29日 当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 700		0	
財政	27,400		1,000		30,000	
資金過不足	25,900		300		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 1,000		
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				
ＥＴＦ買入			900			
国債補完供給	▲ 2,400	2,400		2,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	112,900		2,600		30,000	
当座預金残高	5,108,900		5,111,500		5,141,500	
準備預金残高	4,506,400					
積み終了先	4,506,200					
超過準備	4,506,100					
非準備預金先	602,500					

3月26日以降の残り所要積立額	
積数	4,900
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 99.87%	日数	32.26%

●2021年3月25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～▲0.003%の出合いで始まった。引き続き地銀を中心に調達ニーズが強い中、レート水準に大きな変化はなく高い水準での取引が中心となった。一巡後は▲0.03～▲0.01%で散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/26-3/29)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発行市場は機械、食料品業態において大型発行が実施された。償還総額5,000億円程度に対して、発行総額は1,300億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

2021/3/25	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	▲ 0.015				－	▲ 0.094
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.006				－	▲ 0.099
S/N	▲ 0.010	0.001	▲ 0.008				－	－
1W			▲ 0.009				－	▲ 0.109
2W							－	▲ 0.108
3W							－	▲ 0.107
1M							－	▲ 0.108
3M							▲ 0.106	▲ 0.110
6M							▲ 0.115	▲ 0.118
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)
0.080	0.015	28,729.88	324.36	108.79-80	109.08-09

日付	3/18	3/19	3/22	3/23	3/24
日銀当預残	4,869,100	4,885,700	4,966,300	4,995,700	4,996,000
準備預金残	4,301,300	4,313,400	4,378,500	4,399,700	4,392,000
マネタリーベース	6,076,600	6,093,400	6,174,200	6,203,900	6,204,700
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.010%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.015%
コール市場残高	139,144	145,708	160,809	160,402	172,966
うち無担	118,470	123,497	134,987	135,810	147,102
うちO/N	66,147	65,154	76,359	76,782	85,329
うち有担	20,674	22,211	25,822	24,592	25,864

●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)
40年利付国債	13	0.50%	5,000	2021/3/26	2060/3/20	13,999.0	5,000.0	94.0100	**0.6750%**	**100.0000%**			

●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）		2021/3/25	2021/3/26	▲ 0.350	2,338	2,338		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/3/25	2021/3/26	▲ 0.350	0	0				

●2021年3月26日の予定

*3月の都区部消費者物価指数（CPI）
（市場予想：前年同月比（除く生鮮）▲0.2%）

*米国2月の個人所得・消費支出

*国庫短期証券（983回）入札
（3ヶ月、67,000億円、3/29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