

# Central Daily Market Report

2021年3月30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30日 需給速報	2021年3月31日 需給予想	2021年4月1日 当社予想			
銀行券	500	500	0			
財政	40,000	29,900	▲ 33,000			
資金過不足	40,500	30,400	▲ 33,000			
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			15,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 1,600	4,000	▲ 11,700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,100	1,300		1,100		
米ドル資金供給用担保提供						
当預増減	39,100		38,800		▲ 33,000	
当座預金残高	5,188,300		5,227,100		5,194,100	
準備預金残高	4,605,900					
積み終了先	4,604,800				3月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,604,800				積数	1,700
非準備預金先	582,400				1日平均	100
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	99.95%	日数	48.39%		

## ●2021年3月30日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.020~▲0.002%の調達で始まった。引き続き地銀業態を中心に調達意欲は強く、レートは横ばい圏の動きとなった。一巡後は▲0.035~▲0.01%近辺の出会いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は閑散で出会い見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/31-4/1)は、▲0.15~▲0.11%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と同額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.004%、按分落札利回較差+0.004%と、やや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発行市場は月初発行にあたり、償還は少額で、発行総額は7,000億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/30	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.086	0.085	0.020	29,432.70	48.18	109.83-84	110.22-24		
T/N	▲ 0.030	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.112								
S/N			▲ 0.010				-	-								
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.103								
2W							-	▲ 0.101								
3W			▲ 0.004				-	▲ 0.103								
1M							-	▲ 0.103								
3M							▲ 0.100	▲ 0.107								
6M							▲ 0.113	▲ 0.116								
1Y							▲ 0.130	▲ 0.138								
											日付	3/23	3/24	3/25	3/26	3/29
											日銀当預残	4,995,700	4,996,000	5,108,900	5,111,500	5,149,200
											準備預金残	4,399,700	4,392,000	4,506,900	4,509,800	4,555,000
											マネタリーベース	6,203,900	6,204,700	6,319,000	6,322,300	6,360,600
											無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.015%	▲0.015%	▲0.014%	▲0.014%
											コール市場残高	160,402	172,966	156,004	178,484	165,206
											うち無担	135,810	147,102	129,336	151,566	138,028
											うちO/N	76,782	85,329	72,973	93,428	77,360
											うち有担	24,592	25,864	26,668	26,918	27,178

## ●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)
2年利付国債	423	0.005%	30,000	2021/4/1	2023/4/1	88,927.0	24,539.00	100.2500	▲0.1190%	21.9279%	100.2630	▲0.1260%	5,450.0

## ●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
国庫短期証券買入	15,000	2021/3/31			48,491	15,010	0.004		0.004	94.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/30	2021/3/31	▲ 0.350	1,141	1,125		▲ 0.350	▲ 0.360	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/30	2021/3/31	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/1	2021/4/8	0.320	0	0				
米ドル資金供給		2021/4/1	2021/6/24	0.320	0	0				

## ●2021年3月31日の予定

\*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲1.2%)  
\*2月の住宅着工統計

\*米国3月のシカゴPM景況感指数  
\*英国10-12月期のGDP確報値  
\*ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値

◆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お客様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