

Central Daily Market Report

2021年3月31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31日		2021年4月1日		2021年4月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		▲ 300		0	
財政	34,400		▲ 33,000		▲ 30,000	
資金過不足	34,900		▲ 33,300		▲ 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	15,000					
国債買入			5,200			
CP等買入	4,000	▲ 11,700		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 5,900	1,100		5,900		
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	37,400		▲ 22,300		▲ 30,000	
当座預金残高	5,225,700		5,203,400		5,173,400	
準備預金残高	4,633,900					
積み終了先	4,633,900		4月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,632,400		積数	200		
非準備預金先	591,800		1日平均	0		
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	99.99%	日数	51.61%		

●2021年3月31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▲0.08~▲0.01%での調達で始まった。年度末を跨ぐ取引であることから調達を控える先もみられ、レートは大幅に低下した。一巡後は▲0.07~▲0.01%台の出合いが少額見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は引き続き閑散で、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(4/1-4/2)は、▲0.095~▲0.09%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、償還はなく、発行総額は2,500億円程度。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

2021/3/31	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.177	0.090	0.005	29,178.80	▲ 253.90	110.30-32	110.73-74
T/N	▲ 0.007	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.094						
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.096						
3W	▲ 0.005	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.100	▲ 0.106						
6M							▲ 0.113	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.138						
									日付	3/24	3/25	3/26	3/29	3/30
									日銀当預残	4,996,000	5,108,900	5,111,500	5,149,200	5,188,300
									準備預金残	4,392,000	4,506,900	4,509,800	4,555,000	4,606,000
									マネタリーベース	6,204,700	6,319,000	6,322,300	6,360,600	6,399,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.015%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%
									コール市場残高	172,966	156,004	178,484	165,206	151,586
									うち無担	147,102	129,336	151,566	138,028	130,110
									うちO/N	85,329	72,973	93,428	77,360	72,492
									うち有担	25,864	26,668	26,918	27,178	21,476

●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)	残札総額(億円・百万ドル)	抜分レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均残札レート・利回差・価格差	抜分比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/4/1			9,073	3,705	0.002		0.004	19.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2021/4/1			3,639	1,205	0.016		0.017	26.0
国債買入(残存期間25年超)	300	2021/4/1			1,277	301	0.017		0.018	19.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/3/31	2021/4/1	▲ 0.350	5,868	5,868		▲ 0.350	▲ 0.359	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/31	2021/4/1	▲ 0.350	0	0				

●2021年4月1日の予定

*3月調査の日銀短観(概要及び要旨) (市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI)+0)	*米国2月の建設支出 *米国3月のISM製造業景況指数	*10年利付国債入札 (26,000億円、4/2発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、4/9借入)
---	--------------------------------	--

◆本資料は信頼できるとさ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