

# Central Daily Market Report

2021年3月3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3日		2021年3月4日		2021年3月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 400			0
財政	▲ 74,900		2,000		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 75,000		1,600		▲ 5,000	
<b>金融調節</b>						
	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		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)	6,800	▲ 4,100				
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	▲ 400	100		400		
<small>*ドル資金供給用担保提供額</small>						
当預増減	▲ 57,700		1,900		▲ 5,000	
当座預金残高	4,829,800		4,831,700		4,826,700	
準備預金残高	4,252,000					
積み終了先	4,251,900		3月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,251,900		積数	200		
非準備預金先	577,800		1日平均	0		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,263,100	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	57.14%		

## ●2021年3月3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▲0.03~▲0.003%の出合いで始まった。都銀・信託業態が引き続き調達ニーズを強めていることや、本日は税揚げ等で資金不足日となっていることもあり、相場は強含みで推移した。ターム物はオファーが少ない中、ショートターム物で▲0.01%近辺の引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(3/4-3/5)は、▲0.09~▲0.08%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2Y410~421、5Y136~146、10Y345~361、20Y167~175、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市場は、償還が240億円に対して発行額は900億円と、発行超であった。発行レートは、買いニーズが引き続き強く、期間に関わらず低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/3/3	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.083	0.115	▲ 0.010	29,559.10	150.93	106.75-76	106.81-83
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.010				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.007				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.110	▲ 0.106						
6M							▲ 0.118	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.137						
									日付	2/24	2/25	2/26	3/1	3/2
									日銀当預残	4,927,800	4,920,200	4,938,700	4,900,600	4,887,500
									準備預金残	4,334,800	4,301,900	4,326,100	4,327,200	4,301,000
									マネタリーベース	6,134,000	6,127,800	6,147,200	6,109,200	6,096,400
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.022%	▲0.022%	▲0.024%	▲0.022%
									コール市場残高	144,490	147,992	159,541	154,942	138,252
									うち無担	124,138	127,433	138,475	133,791	117,470
									うちO/N	75,500	78,975	92,122	86,088	70,187
									うち有担	20,352	20,559	21,066	21,151	20,782

## ●入札結果

名称	回数	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	業分率	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)	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)		2021/3/3	2021/3/4	▲0.350	361	361		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/3	2021/3/4	▲0.350	0	0				

## ●2021年3月4日の予定

*2月の消費動向調査	*米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫	*30年利付国債入札(9,000億円、3/5発行)
		*交付税特別会計借入(10,500億円、3/12借入)

◆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