

Central Daily Market Report

2021年3月18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18日 需給速報	2021年3月19日 需給予想	2021年3月22日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 200	1,000			
財政	7,800	16,400	87,000			
資金過不足	7,300	16,200	88,000			
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	13,400					
CP等買入	6,000	▲ 400	▲ 800			
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,300	300	1,300			
※ドル資金供給用担保提供減						
当増減	25,300	15,900	88,000			
当座預金残高	4,869,100	4,885,000	4,973,000			
準備預金残高	4,300,900					
積み終了先	4,288,700			3月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,269,200			積数	24,200	
非準備預金先	568,200			1日平均	900	
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	99.33%	日数	9.68%		

●2021年3月18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～▲0.004%での調達で始まった。一巡後は調整の出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては期内のショートターム物で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(3/19-3/22)は、▲0.085～▲0.080%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、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＞

本日はTB3M物(981回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.101%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1009%、按分落札利回▲0.0986%と、やや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▲0.106%出合いと、堅調に推移した。

＜CP市場＞

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額3,050億円程度に対して、発行総額は850億円程度と償還超であった。案件数は多くなく、小型案件を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/3/18	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	▲ 0.014				-	▲ 0.078	0.100	0.010	30,216.75	302.42	108.89-90	109.20-22
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
2W			0.001				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.101						
1M			▲ 0.007				-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.106	▲ 0.106						
6M							▲ 0.127	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.138						
									日付	3/11	3/12	3/15	3/16	3/17
									日銀当預残	4,813,000	4,819,300	4,829,500	4,832,400	4,843,800
									準備預金残	4,270,300	4,269,800	4,258,800	4,262,900	4,270,500
									マネタリーベース	6,020,800	6,027,100	6,036,600	6,039,200	6,050,800
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.013%	▲0.016%	▲0.019%	▲0.018%
									コール市場残高	142,822	142,202	129,743	149,291	139,639
									うち無担	121,483	121,466	109,614	129,036	118,800
									うちO/N	74,190	66,403	61,216	81,048	64,907
									うち有担	21,339	20,736	20,129	20,255	20,839

●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	981	-	67,000	2021/3/22	2021/6/28	179,586.3	54,753.6	100.0265	▲0.0986%	50.3051%	100.0271	▲0.1009%	12,246.0

●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)		2021/3/18	2021/3/19	▲ 0.350	999	999		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/18	2021/3/19	▲ 0.350	199	199		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年3月19日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁定例会見
- *2月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.4%)

◆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