

Central Daily Market Report

2021年3月29日(月)
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29日		2021年3月30日		2021年3月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		500		800	
財政	31,200		37,500		30,700	
資金過不足	30,600		38,000		31,500	
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	8,900					
CP等買入		▲ 1,200		▲ 1,600	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
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	700		1,300		
<small>*ドル資金供給用担保提供減</small>						
当増減	37,700		37,700		35,500	
当座預金残高	5,149,200		5,186,900		5,222,400	
準備預金残高	4,557,500					
積み終了先	4,556,300				3月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,556,300				積数	2,900
非準備預金先	591,700				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	99.92%	日数	45.16%		

●2021年3月29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▲0.025～▲0.002%の調達で始まった。週末要因は剥落したものの、引き続き調達ニーズは強く、レートは横ばいであった。一巡後は▲0.03～▲0.01%近辺の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(3/30-3/31)は、▲0.100～▲0.085%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、3M物が▲0.096%、6M物が▲0.115%、1Y物が▲0.131～▲0.129%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は月末発行にあたり、償還総額は28,000億円程度に対し発行総額は4,800億円程度となった。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

2021/3/29	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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				-	▲ 0.085	0.065	▲ 0.010	29,384.52	207.82	109.79-80	109.65-66
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.090						
S/N	▲ 0.150	▲ 0.010	▲ 0.091				-	-						
1W	▲ 0.010	0.005	▲ 0.006				-	▲ 0.105						
2W							-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.095	▲ 0.108						
6M							▲ 0.115	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.138						
									日付	3/22	3/23	3/24	3/25	3/26
									日銀当預残	4,966,300	4,995,700	4,996,000	5,108,900	5,111,500
									準備預金残	4,378,500	4,399,700	4,392,000	4,506,900	4,509,800
									マネタリーベース	6,174,200	6,203,900	6,204,700	6,319,000	6,322,300
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.015%	▲0.015%	▲0.014%
									コール市場残高	160,809	160,402	172,966	156,004	178,484
									うち無担	134,987	135,810	147,102	129,336	151,566
									うちO/N	76,359	76,782	85,329	72,973	93,428
									うち有担	25,822	24,592	25,864	26,668	26,918

●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)		2021/3/29	2021/3/30	▲ 0.350	1,292	1,292		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/3/29	2021/3/30	▲ 0.350	0	0				

●2021年3月30日の予定

*2月の完全失業率(市場予想:3.0%)	*米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(30,000億円、4/1発行)
*2月の有効求人倍率(市場予想:1.1倍)	*米国3月のCB消費者信頼感指数	
*2月の商業動態統計速報		

◆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