

Central Daily Market Report

2021年2月2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2月2日 需給速報	2021年2月3日 需給予想	2021年2月4日 当社予想
銀行券	700	500	0
財政	▲ 16,800	▲ 81,800	1,000
資金過不足	▲ 16,100	▲ 81,300	1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		10,000	
国債買入			
CP等買入		▲ 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	▲ 100	100	100
米ドル資金供給用担保提供枠			
当預増減	▲ 16,100	▲ 71,300	1,000
当座預金残高	4,925,600	4,854,300	4,855,300
準備預金残高	4,336,300		
積み終了先	4,336,300	2月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,336,200	積数	200
非準備預金先	589,300	1日平均	0
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,604,600
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			58.06%

●2021年2月2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▲0.035~▲0.005%の出会いで始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物はオファーが少ない中、目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(2/3-2/4)は、▲0.09~▲0.08%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2Y410~420、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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペが前回から10,000億円減額の10,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.003%、按分落札利回り較差+0.003%と、やや弱めな結果となった。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市場は、複数件の入札が実施されて総額400億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移しており、玉確保のための入札が引き続き堅調といえる。

●短期金融市場関連指標

2021/2/2	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	
	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.082	0.050	▲ 0.005	28,362.17	271.12	104.88-89	104.98-99
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.038	▲ 0.008	▲ 0.018				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.090						
1M			0.001				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.105	▲ 0.100						
6M							▲ 0.110	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.138						
									日付	1/26	1/27	1/28	1/29	2/1
									日銀当預残	4,874,100	4,941,900	4,947,800	4,959,000	4,941,700
									準備預金残	4,298,200	4,349,400	4,353,400	4,354,800	4,363,000
									マネタリーベース	6,079,700	6,147,900	6,154,100	6,165,300	6,147,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.012%	▲ 0.016%
									コール市場残高	128,862	135,232	129,670	124,695	127,946
									うち無担	107,646	113,824	108,897	104,323	107,757
									うちO/N	63,258	69,361	64,684	60,740	64,434
									うち有担	21,216	21,408	20,773	20,372	20,189

●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)
10年利付国債	361	0.10%	26,000	2021/2/3	2030/12/20	72,550.0	21,221.00	100.4500	0.0540%	62.9236%	100.4600	0.0530%	4,767.0

●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	10,000	2021/2/3			32,900	10,003	0.003		0.003	66.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/2	2021/2/3	▲ 0.350	62	62		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/2	2021/2/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/2/4	2021/2/12	0.320	0	0				
米ドル資金供給		2021/2/4	2021/4/30	0.310	0	0				

●2021年2月3日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国1月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入(10,000億円、2/12借入)
	*ユーロ圏1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