

Central Daily Market Report

2021年2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2月3日		2021年2月4日		2021年2月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		200		▲ 1,000	
財政	▲ 81,800		▲ 300		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 81,300		▲ 100		▲ 13,000	
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	10,000					
国債買入			7,800			
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						
国債補充供給		100				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 71,300		7,700		▲ 13,000	
当座預金残高	4,854,300		4,862,000		4,849,000	
準備預金残高	4,297,500					
積み終了先	4,297,500		2月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,297,500		積数		200	
非準備預金先	556,800		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	61.29%		

●2021年2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、邦銀を中心に▲0.030~▲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>

GC T/N(2/4~2/5)は、▲0.085~▲0.075%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2Y410~421、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>

本日のアウトライト市場は、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、償還が約800億円であったのに対し、発行総額は入札件数が少なく、400億円程度にとどまった。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/2/3	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.081	0.055	0.005	28,646.50	284.33	105.02-03	105.05-06
T/N	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	0.010	▲ 0.001				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.020	▲ 0.007	▲ 0.010				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.105	▲ 0.099						
6M							▲ 0.110	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.138						
									日付	1/27	1/28	1/29	2/1	2/2
									日経当預残	4,941,900	4,947,800	4,959,000	4,941,700	4,925,600
									準備預金残	4,349,400	4,353,400	4,354,800	4,363,000	4,336,800
									マネタリーベース	6,147,900	6,154,100	6,165,300	6,147,400	6,130,600
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.016%	▲0.013%
									コール市場残高	135,232	129,670	124,695	127,946	122,360
									うち無担	113,824	108,897	104,323	107,757	101,612
									うちO/N	69,361	64,684	60,740	64,434	58,089
									うち有担	21,408	20,773	20,372	20,189	20,748

●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)
交付税特会	-	-	10,000	2021/2/12	2021/8/13	367,752.0	10,000.20		0.0000%	2.7193%		0.0000%	

●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	応募総額(億円・百万ドル)	発札総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均発札レート・利回較差・価格較差	抜付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/2/4			12,063	4,004	▲0.002		0.000	10.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/2/4			11,416	3,707	▲0.009		▲0.007	17.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/3	2021/2/4	▲ 0.350	34	34		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/3	2021/2/4	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3,000	2021/2/8			4,587	3,000	▲0.078		▲0.056	46.8

●2021年2月4日の予定

*米国12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、2/5発行)
*英中銀MPC結果発表	

◆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