

Central Daily Market Report

2021年2月4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2月4日 需給速報	2021年2月5日 需給予想	2021年2月8日 当社予想			
銀行券	200	700	1,000			
財政	0	▲ 7,600	▲ 3,000			
資金過不足	200	▲ 6,900	▲ 2,000			
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	7,800					
CP等買入			▲ 200			
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	▲ 300		300			
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当増減	7,700		▲ 6,800			▲ 2,000
当座預金残高	4,862,000		4,855,200			4,853,200
準備預金残高	4,287,300					
積み終了先	4,287,300				2月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,287,300				積数	200
非準備預金先	574,700				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	64.52%		

●2021年2月4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%の出会いが始まった。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(2/5~2/8)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500億円弱に対して、大型の発行案件がなかったことから、発行総額は320億円となった。発行レートは、銘柄により水準がまちまちであるものの、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/2/4	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.081	0.055	0.000	28,341.95	▲ 304.55	104.99-01	105.19-20
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.024				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.105	▲ 0.101						
6M							▲ 0.110	▲ 0.110						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.138						
									日付	1/28	1/29	2/1	2/2	2/3
									日銀当預残	4,947,800	4,959,000	4,941,700	4,925,600	4,854,300
									準備預金残	4,353,400	4,354,800	4,363,000	4,336,800	4,298,300
									マネタリーベース	6,154,100	6,165,300	6,147,400	6,130,600	6,058,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.012%	▲ 0.016%	▲ 0.013%	▲ 0.013%
									コーポレート市場残高	129,670	124,695	127,946	122,360	129,297
									うち無担	108,897	104,323	107,757	101,612	106,416
									うちO/N	64,684	60,740	64,434	58,089	61,583
									うち有担	20,773	20,372	20,189	20,748	22,881

●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)
30年利付国債	69	0.70%	9,000	2021/2/5	2050/12/20	25,527.0	7,348.00	100.8500	0.6650%	3.2505%	100.9400	0.6620%	1,644.0

●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)		2021/2/4	2021/2/5	▲ 0.350	274	274		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/4	2021/2/5	▲ 0.350	0	0				

●2021年2月5日の予定

- *12月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.4%)
- *12月の景気動向指数速報
- *1月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国12月の貿易収支
- *米国12月の消費者信用残高
- *米国1月の雇用統計
- *国庫短期証券(970回)入札(3ヶ月、67,000億円、2/8発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、2/18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