

Central Daily Market Report

2021年2月5日(金)

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5日 需給速報	2021年2月8日 需給予想	2021年2月9日 当社予想
銀行券	700	400	0
財政	▲ 6,100	▲ 6,500	▲ 2,000
資金過不足	▲ 5,400	▲ 6,100	▲ 2,000
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			
国債買入		6,700	
CP等買入	▲ 200	▲ 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		3,000	
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入		600	
国債補完供給	▲ 400	300	400
※ドル資金供給用担保提供額			
当預増減	▲ 5,700	4,500	▲ 2,000
当座預金残高	4,856,300	4,860,800	4,858,800
準備預金残高	4,295,500		
積み終了先	4,295,500	2月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,295,500	積数	100
非準備預金先	560,800	1日平均	0
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,617,200
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			74.19%

●2021年2月5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~▲0.003%の出会いで始まった。週末3日積みにあたることから、一部取り上がる先が見られた。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(2/8-2/9)は、▲0.09~▲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>

本日はTB3M物(970回)の入札が実施された。WI取引において特段の出会いは見られなかったものの、平均落札利回▲0.0942%、按分落札利回▲0.0912%と、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、▲0.100~▲0.096%出会いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、発行と償還がいずれも少なく閑散としていた。発行レートは概ね同水準で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/2/5	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.080	0.055	0.000	28,779.19	437.24	105.57-58	105.49-50
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.006				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.008				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.001	0.000	▲ 0.001				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.104	▲ 0.101						
6M							▲ 0.110	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.138						
									日付	1/29	2/1	2/2	2/3	2/4
									日銀当預残	4,959,000	4,941,700	4,925,600	4,854,300	4,862,000
									準備預金残	4,354,800	4,363,000	4,336,800	4,298,300	4,287,800
									マネタリーベース	6,165,300	6,147,400	6,130,600	6,058,700	6,066,300
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.016%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.011%
									コール市場残高	124,695	127,946	122,360	129,297	128,960
									うち無担	104,323	107,757	101,612	106,416	107,886
									うちO/N	60,740	64,434	58,089	61,583	63,733
									うち有担	20,372	20,189	20,748	22,881	21,074

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	970	-	67,000	2021/2/8	2021/5/17	207,760.0	55,637.2	100.0245	▲0.0912%	30.2901%	100.0253	▲0.0942%	11,362.0
交付税特会	-	-	10,500	2021/2/18	2021/8/20	361,182.0	10,500.04		0.0000%	2.9072%		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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2021/2/8			2,876	1,000	0.002		0.003	19.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/2/8			10,213	4,209	▲0.003		▲0.002	95.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2021/2/8			4,944	1,211	▲0.003		0.000	53.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/5	2021/2/8	▲0.350	396	396		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/5	2021/2/8	▲0.350	0	0				

●2021年2月8日の予定

*12月の国際収支	*10年物価連動国債入札
*12月の特定サービス産業動態統計速報	(2,000億円、2/9発行)
*1月の景気ウォッチャー調査	

◆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