

Central Daily Market Report

2021年2月9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9日		2021年2月10日		2021年2月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		100		0	
財政	▲ 2,200		▲ 6,600		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 2,400		▲ 6,500		▲ 5,000	
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						▲ 4,000
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,500			
CP等買入		▲ 200		▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入	100					
国債補完供給	▲ 500	400		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 2,600		5,400		▲ 9,000	
当座預金残高	4,856,800		4,862,200		4,853,200	
準備預金残高	4,294,200					
積み終了先	4,294,200		2月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,294,200		積数		0	
非準備預金先	562,600		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	80.65%		

●2021年2月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.02~▲0.005%での調達で始まった。参加者の動向に大きな変化は無く、前日とほぼ同水準での取引となった。一巡後は▲0.05~▲0.008%の出合いが見られた。ターム物はオファーが少ない中、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/10-2/12)は、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。SCはローラー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TB6M物(971回)の入札が実施された。WI取引において▲0.103~▲0.101%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1048%、按分落札利回▲0.1027%と、順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.110%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.103%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、陸連業態で大型発行があり、償還総額は1,300億円程度に対し発行総額は300億円程度であった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入オベが、予定通りの6,000億円でオファーされた。平均落札レート▲0.022%、按分レート▲0.034%と、前回比で平均は上昇、按分は横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2021/2/9	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	▲ 0.055	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.081	0.065	0.000	29,505.93	117.43	105.20-21	104.77-78
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.085						
S/N	▲ 0.007	▲ 0.006	▲ 0.007				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.009				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.087						
3W			0.001				-	▲ 0.090						
1M							-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.103	▲ 0.099						
6M							▲ 0.110	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.138						
									日付	2/2	2/3	2/4	2/5	2/8
									日銀当預残	4,925,600	4,854,300	4,862,000	4,856,300	4,859,400
									準備預金残	4,336,800	4,298,300	4,287,800	4,295,700	4,302,400
									マネタリーベース	6,130,600	6,058,700	6,066,300	6,059,900	6,062,600
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.013%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.011%
									コール市場残高	122,360	129,297	128,960	147,545	126,524
									うち無担	101,612	106,416	107,886	126,498	105,861
									うちO/N	58,089	61,583	63,733	68,335	51,478
									うち有担	20,748	22,881	21,074	21,047	20,663

●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)
国庫短期証券	971	-	34,000	2021/2/10	2021/8/10	126,380.0	27,716.5	100.0510	▲0.1027%	22.9064%	100.0520	▲0.1048%	6,283.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/2/10			14,879	4,005	▲0.002		▲0.001	4.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/2/10			9,899	3,710	▲0.003		▲0.002	28.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/2/10			11,033	4,215	▲0.004		▲0.003	24.4
国債買入(残存期間25年超)	300	2021/2/10			1,459	301	0.007		0.008	60.2
CP等買入	6,000	2021/2/15			9,043	5,973	▲0.034		▲0.022	35.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/9	2021/2/10	▲ 0.350	461	461		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/9	2021/2/10	▲ 0.350	6	6		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2021/2/12	2021/2/19	0.320	2	2				
米ドル資金供給		2021/2/12	2021/4/30	0.320	0	0				

●2021年2月10日の予定

*中村日銀審議委員、高知県金融経済懇談会において講演	*米国12月の卸売売上高	*流動性供給入札(5,000億円、2/12発行)
*1月の企業物価指数	*米国1月の財政収支	*エネルギー対策借入(5,500億円、2/22借入)
	*米国1月の消費者物価指数	

◆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お客様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