

# Central Daily Market Report

2021年2月10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10日		2021年2月12日		2021年2月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		300		0	
財政	▲ 6,700		▲ 4,300		56,000	
資金過不足	▲ 6,700		▲ 4,000		56,000	
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			3,600	▲ 4,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			15,000			
国債買入	12,500					
CP等買入		▲ 1,100		▲ 100	6,000	
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			500			
国債補完供給	▲ 800	500		800		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	4,400		11,800		62,000	
当座預金残高	4,861,200		4,873,000		4,935,000	
準備預金残高	4,311,200					
積み終了先	4,311,200		2月12日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,311,200		積数		0	
非準備預金先	550,000		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	87.10%		

## ●2021年2月10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▲0.015~▲0.003%での調達で始まった。祝日を跨ぐ取引であることから、一部取り上がる先も見られた。一巡後も同水準で推移し、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(2/12-2/15)は、▲0.085~▲0.080%程度での出合い。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、短国買入オペアが前回から5,000億円増額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.004%、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、6M物が▲0.112%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、建設・機械業態で大型発行があり、償還総額は1,100億円程度に対し発行総額は1,600億円程度。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/2/10	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.008				-	▲ 0.081	0.075	0.010	29,562.93	57.00	104.57-59	104.51-52
T/N	▲ 0.006	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.014	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.040	0.013	▲ 0.016				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.103	▲ 0.100						
6M							▲ 0.112	▲ 0.110						
1Y							▲ 0.129	▲ 0.138						
									日付	2/3	2/4	2/5	2/8	2/9
									日銀当預残	4,854,300	4,862,000	4,856,300	4,859,400	4,856,800
									準備預金残	4,298,300	4,287,800	4,295,700	4,302,400	4,294,200
									マネタリーベース	6,058,700	6,066,300	6,059,900	6,062,600	6,060,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.010%
									コール市場残高	129,297	128,960	147,545	126,524	123,820
									うち無担	106,416	107,886	126,498	105,861	102,598
									うちO/N	61,583	63,733	68,335	51,478	56,365
									うち有担	22,881	21,074	21,047	20,663	21,222

## ●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)
流動性供給	327	-	5,000	2021/2/12		15,486.0	4,988.0		0.0030%	60.4151%		0.0020%	
エネルギー対策	-	-	5,500	2021/2/22	2022/2/21	147,610.0	5,499.95		0.0000%	3.7261%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2021/2/12	2021/2/25		3,550	3,550				
国庫短期証券買入	15,000	2021/2/12			45,122	15,003	0.003		0.004	61.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/10	2021/2/12	▲ 0.350	818	818		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/10	2021/2/12	▲ 0.350	20	20		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2021年2月12日の予定

*米国2月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(972回)入札
*英国10-12月期のGDP速報値	(3ヶ月、67,000億円、2/15発行)

◆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