

Central Daily Market Report

2021年2月12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12日		2021年2月15日		2021年2月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		100		0	
財政	▲ 6,300		59,000		1,000	
資金過不足	▲ 6,000		59,100		1,000	
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						
CP等買入		▲ 100	6,000	▲ 900		
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	▲ 1,100	800		1,100		
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	8,700		65,300		1,000	
当座預金残高	4,869,900		4,935,200		4,936,200	
準備預金残高	4,296,900					
積み終了先	4,296,900		2月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,296,900		積数		0	
非準備預金先	573,000		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	96.77%		

●2021年2月12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▲0.01~▲0.003%での調達で始まった。積み最終日を直前に控えた取り調整の動きに加え、週末要因も重なったことでレート水準は高止まりした。一巡後もほぼ横ばい圏で推移し、今週の取引を終えた。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>

GC T/N(2/15-2/16)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TB3M物(972回)の入札が実施された。WI取引において▲0.098~▲0.097%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0979%、按分落札利回▲0.0949%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、▲0.108~▲0.105%出合いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は閑散で、発行・償還ともに200億円程度にとどまった。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

2021/2/12	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.081	0.060	▲ 0.015	29,520.07	▲ 42.86	104.75-76	104.92-93
T/N	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.008	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.015	0.040	▲ 0.009				-	▲ 0.095						
3M			0.005				▲ 0.108	▲ 0.100						
6M							▲ 0.115	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.138						
									日付	2/4	2/5	2/8	2/9	2/10
									日銀当預残	4,862,000	4,856,300	4,859,400	4,856,800	4,861,200
									準備預金残	4,287,800	4,295,700	4,302,400	4,294,200	4,311,200
									マネタリーベース	6,066,300	6,059,900	6,062,600	6,060,200	6,064,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.008%
									コール市場残高	128,960	147,545	126,524	123,820	118,196
									うち無担	107,886	126,498	105,861	102,598	97,291
									うちO/N	63,733	68,335	51,478	56,365	51,858
									うち有担	21,074	21,047	20,663	21,222	20,905

●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	972	-	67,000	2021/2/15	2021/5/24	201,942.8	54,625.9	100.0255	▲0.0949%	25.8983%	100.0263	▲0.0979%	12,373.0

●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)		2021/2/12	2021/2/15	▲ 0.350	1,113	1,113		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/12	2021/2/15	▲ 0.350	0	0				

●2021年2月15日の予定

*10-12月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率+9.5%)
*12月の石油等消費動態統計

*New York祝日(Presidents' Day)

◆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