

# Central Daily Market Report

2021年2月16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16日		2021年2月17日		2021年2月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		▲ 300		▲ 1,000	
財政	3,100		▲ 27,000		▲ 1,000	
資金過不足	3,700		▲ 27,300		▲ 2,000	
<b>金融調節</b>	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			10,000			
国債買入	12,400					
CP等買入		▲ 300		▲ 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						
国債補充供給	▲ 1,100	200		1,100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	14,900		▲ 16,400		▲ 2,000	
当座預金残高	4,946,000		4,929,600		4,927,600	
準備預金残高	4,331,400					
積み終了先	3,041,900				2月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,342,900				積数	274,600
非準備預金先	614,600				1日平均	10,200
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,263,100
準備預金進捗率	実績	91.58%	日数	3.57%		

## ●2021年2月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み期間が切り替わったことで大手行からは調達レートを引き下げる動きが見られた一方、地銀業態を中心に強い調達意欲を示す先も多く、全体のレートは前日比でやや低下するにとどまった。立ち上がりは、地銀・証券業態などから▲0.06~▲0.005%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.08~▲0.02%のレンジの出会いで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(2/17-2/18)は、▲0.095~▲0.085%程度での出会い。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2Y410~420、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、短国買入オペが前回から5,000億円減額の10,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.003%、按分落札利回り較差+0.001%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、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額800億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超であった。案件こそ多かったものの、小型案件が中心の落ち着いたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/2/16	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.085	0.075	0.000	30,467.75	383.60	105.38-39	105.48-49
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.028	▲ 0.007	▲ 0.011				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.009				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.108	▲ 0.101						
6M							▲ 0.117	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.138						
									日付	2/8	2/9	2/10	2/12	2/15
									日銀当預残	4,859,400	4,856,800	4,861,200	4,869,900	4,931,100
									準備預金残	4,302,400	4,294,200	4,311,200	4,296,900	4,369,200
									マネタリーベース	6,062,600	6,060,200	6,064,600	6,072,900	6,133,900
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.011%	▲0.008%
									コール市場残高	126,524	123,820	118,196	131,346	120,008
									うち無担	105,861	102,598	97,291	109,620	98,882
									うちO/N	51,478	56,365	51,858	65,617	58,529
									うち有担	20,663	21,222	20,905	21,726	21,126

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
5年利付国債	146	0.10%	25,000	2021/2/17	2025/12/20	71,535.0	20,494.0	100.9600	▲0.0970%	72.1873%	100.9800	▲0.1010%	4,501.0
国有林野借入	-	-	959	2021/2/25	2026/2/25	6,255.0	959.00		0.0000%	20.0000%		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
国庫短期証券買入	10,000	2021/2/17			30,502	10,002	0.001		0.003	30.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/16	2021/2/17	▲ 0.350	961	961		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/16	2021/2/17	▲ 0.350	160	160		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2021年2月17日の予定

\*12月の機械受注統計(市場予想：電力除く民需、前月比▲6.2%)  
\*1月の貿易統計

\*米国12月の企業在庫  
\*米国1月の生産者物価指数  
\*米国1月の小売売上高  
\*米国1月の鉱工業生産・設備稼働率  
\*英国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