

# Central Daily Market Report

2021年2月17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17日		2021年2月18日		2021年2月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 26,200		4,700		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 26,600		3,600		▲ 4,000	
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						
国債売現						
国庫短期証買入	10,000					
国債買入						
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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	1,100		100		
米ドル資金供給用担保国債供給						
当増減	▲ 15,800		3,600		▲ 4,000	
当座預金残高	4,930,200		4,933,800		4,929,800	
準備預金残高	4,321,100					
積み終了先	4,287,900		2月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,069,500		積数		22,700	
非準備預金先	609,100		1日平均		900	
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	99.30%	日数	7.14%		

## ●2021年2月17日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き地銀業態からの資金調達意欲が強く、出合い水準は前日とほぼ横ばいとなった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.055~▲0.005%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.06~▲0.02%のレンジの出合いで推移した。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(2/18-2/19)は、▲0.095~▲0.085%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2Y410~420、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、動意なく閑散な中、6M物が▲0.115~▲0.114%で出合った。

### <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1,500億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超であった。5・10日の前倒し発行が見られ、案件が膨らみ比較的活況な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

2021/2/17	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.088	0.095	0.020	30,292.19	▲ 175.56	106.11-12	106.02-03
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.007				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.015				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.109	▲ 0.103						
6M							▲ 0.115	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.138						
									日付	2/9	2/10	2/12	2/15	2/16
									日銀当預残	4,856,800	4,861,200	4,869,900	4,931,100	4,946,000
									準備預金残	4,294,200	4,311,200	4,296,900	4,369,200	4,333,200
									マネタリーベース	6,060,200	6,064,600	6,072,900	6,133,900	6,148,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.008%	▲ 0.011%	▲ 0.008%	▲ 0.021%
									コール市場残高	123,820	118,196	131,346	120,008	135,313
									うち無担	102,598	97,291	109,620	98,882	114,899
									うちO/N	56,365	51,858	65,617	58,529	70,936
									うち有担	21,222	20,905	21,726	21,126	20,414

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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)		2021/2/17	2021/2/18	▲ 0.350	100	100		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/17	2021/2/18	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/2/19	2021/2/26	0.320	1	1				
米ドル資金供給		2021/2/19	2021/5/13	0.320	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	1,500	2021/2/22			2,776	1,500	0.015		0.034	38.7
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2021/2/18	2021/3/1		2	2		▲ 0.100	▲ 0.100	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第8回	2021/2/19	2023/2/17	0

## ●2021年2月18日の予定

\*米国1月の住宅着工件数

\*国庫短期証券(973回)入札(1年、35,000億円、2/22発行)

\*20年利付国債入札(12,000億円、2/19発行)

\*交付税特別会計借入(10,500億円、3/2借入)

◆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