

Central Daily Market Report

2021年2月18日(木)

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18日		2021年2月19日		2021年2月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 800			0
財政	8,500		▲ 2,900		▲ 34,000	
資金過不足	7,400		▲ 3,700		▲ 34,000	
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 1,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100	1,500	
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供						
当増減	7,300		▲ 4,700		▲ 32,500	
当座預金残高	4,937,500		4,932,800		4,900,300	
準備預金残高	4,339,300					
積み終了先	4,334,600					
超過準備	4,325,700					
非準備預金先	598,200					
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	99.72%	日数	10.71%		

●2021年2月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態の調達姿勢にあまり変化は見られず、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▲0.05~▲0.005%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.06~▲0.015%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(2/19-2/22)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>

本日はTB1Y物(973回)の入札が実施された。WI取引において▲0.120%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1221%、按分落札利回▲0.1221%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、▲0.140~▲0.135%出合いと、強含みで推移した。

<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850億円程度に対して、発行総額は2,400億円程度と発行超であった。複数業態において大型発行が見られ、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

2021/2/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買差額計値	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.092	0.090	▲ 0.005	30,236.09	▲ 56.10	105.85-86	105.81-82
T/N	▲ 0.012	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.007				-	-						
1W	▲ 0.018	▲ 0.003	▲ 0.011				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.008	▲ 0.005	▲ 0.006				-	▲ 0.094						
3W			0.040				-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.015	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.109	▲ 0.103						
6M							▲ 0.116	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	2/10	2/12	2/15	2/16	2/17
									日銀当預残	4,861,200	4,869,900	4,931,100	4,946,000	4,930,200
									準備預金残	4,311,200	4,296,900	4,369,200	4,333,200	4,322,400
									マネタリーベース	6,064,600	6,072,900	6,133,900	6,148,200	6,132,800
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.011%	▲0.008%	▲0.021%	▲0.022%
									コール市場残高	118,196	131,346	120,008	135,313	136,737
									うち無担	97,291	109,620	98,882	114,899	116,889
									うちO/N	51,858	65,617	58,529	70,936	69,406
									うち有担	20,905	21,726	21,126	20,414	19,848

●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	973	-	35,000	2021/2/22	2022/2/21	119,079.0	28,536.4	100.1220	▲0.1221%	96.2593%	100.1220	▲0.1221%	6,463.0
20年利付国債	175	0.50%	12,000	2021/2/19	2040/12/20	30,559.0	9,773.0	100.2000	▲0.4880%	47.0278%	100.3100	▲0.4820%	2,219.0
交付税特会	-	-	10,500	2021/3/2	2021/8/31	368,147.0	10,500.17		0.0000%	2.8522%		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	平均落札レート・利回較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/18	2021/2/19	▲0.350	95	95		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/18	2021/2/19	▲0.350	2	2		▲0.350	▲0.350	

●2021年2月19日の予定

*月例経済報告	*米国1月の中古住宅販売	*国庫短期証券(974回)入札
*1月の全国消費者物価指数(CPI)		(3ヶ月、67,000億円、2/22発行)
(市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.7%)		

◆本資料は信頼できるとさ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