

Central Daily Market Report

2021年2月19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19日 需給速報	2021年2月22日 需給予想	2021年2月24日 当社予想			
銀行券	▲ 800	▲ 700	▲ 1,000			
財政	▲ 100	▲ 31,500	1,000			
資金過不足	▲ 900	▲ 32,200	0			
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			12,300			
CP等買入		▲ 1,000		▲ 300		
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確保供給						
当増減	▲ 2,000	▲ 18,600				0
当座預金残高	4,935,500	4,916,900	4,916,900			
準備預金残高	4,333,700					
積み終了先	4,332,800			2月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,331,800			積数	3,600	
非準備預金先	601,800			1日平均	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	99.89%	日数	21.43%		

●2021年2月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により取り上がる先が見られたため、出合い水準は前日と比べてやや上昇した。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.04~▲0.003%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.06~▲0.01%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(2/22-2/24)は、▲0.09~▲0.08%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2Y410~420、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TB3M物(974回)の入札が実施された。WI取引において▲0.099%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1020%、按分落札利回▲0.0986%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、▲0.101~▲0.099%出合いと、入札と同水準で推移した。

<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1,000億円程度に対して、発行総額は2,000億円程度と発行超であった。小売・陸運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

2021/2/19	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.087	0.100	0.010	30,017.92	▲ 218.17	105.65-66	105.59-61
T/N	▲ 0.013	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.007				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.007	▲ 0.009				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.015	0.050	▲ 0.007				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.020	0.040	0.007				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.101	▲ 0.103						
6M							▲ 0.115	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	2/12	2/15	2/16	2/17	2/18
									日銀当預残	4,869,900	4,931,100	4,946,000	4,930,200	4,937,500
									準備預金残	4,296,900	4,369,200	4,333,200	4,322,400	4,339,100
									マネタリーベース	6,072,900	6,133,900	6,148,200	6,132,800	6,141,200
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.008%	▲0.021%	▲0.022%	▲0.022%
									コール市場残高	131,346	120,008	135,313	136,737	130,887
									うち無担	109,620	98,882	114,899	116,889	110,927
									うちO/N	65,617	58,529	70,936	69,406	62,614
									うち有担	21,726	21,126	20,414	19,848	19,960

●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	974	-	67,000	2021/2/22	2021/5/31	202,178.6	54,619.0	100.0265	▲0.0986%	18.2814%	100.0274	▲0.1020%	12,380.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万円)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万円)	落札総額(億円・百万円)	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/2/22			10,263	4,001	0.002		0.003	70.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/2/22			10,705	3,703	0.000		0.002	12.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/2/22			8,805	4,206	0.003		0.005	55.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/19	2021/2/22	▲ 0.350	99	99		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/19	2021/2/22	▲ 0.350	0	0				

●2021年2月22日の予定

*1月の企業向けサービス価格指数

◆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