

Central Daily Market Report

2021年2月22日(月)
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22日		2021年2月24日		2021年2月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 600		▲ 1,000	
財政	▲ 34,200		▲ 300		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 35,100		▲ 900		▲ 6,000	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入			15,000			
国債買入	12,300		2,300			
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	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	▲ 200	100		200		
※ドル資金供給用担保提供						
当増減	▲ 21,700		16,100		▲ 9,600	
当座預金残高	4,913,800		4,929,900		4,920,300	
準備預金残高	4,329,100					
積み終了先	4,328,800		2月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,328,600		積数	2,500		
非準備預金先	584,700		1日平均	100		
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	99.92%	日数	28.57%		

●2021年2月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.045~▲0.003%の出合い。週末要因が剥落したものの、調達ニーズは強く若干のレート低下にとどまった。一巡後は▲0.06~▲0.01%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートターム物の引き合いが散見された程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(2/24-2/25)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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペアが前回から5,000億円増額の15,000億円でおファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差+0.002%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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は卸売業態においてまとまった発行が実施された。償還総額2,200億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と償還超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。本日は、CP等買入オペアが事前予定額6,000億円から1,000億円減額の5,000億円、下限レートは前回比▲1bpの▲0.09%でおファーされた。結果は平均落札レート▲0.031%、按分レート▲0.036%と、前回比で平均・按分ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2021/2/22	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.084	0.115	0.015	30,156.03	138.11	105.53-54	105.81-82
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.090						
S/N	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.009				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.008	0.050	0.005				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.001	0.001	0.000				-	▲ 0.099						
3M			▲ 0.001				▲ 0.104	▲ 0.102						
6M							▲ 0.115	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.139						
									日付	2/15	2/16	2/17	2/18	2/19
									日銀当預残	4,931,100	4,946,000	4,930,200	4,937,500	4,935,500
									準備預金残	4,369,200	4,333,200	4,322,400	4,339,100	4,333,700
									マネタリーベース	6,133,900	6,148,200	6,132,800	6,141,200	6,140,100
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.021%	▲0.022%	▲0.022%	▲0.019%
									コール市場残高	120,008	135,313	136,737	130,887	158,386
									うち無担	98,882	114,899	116,889	110,927	137,797
									うちO/N	58,529	70,936	69,406	62,614	81,924
									うち有担	21,126	20,414	19,848	19,960	20,589

●入札結果

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
国庫短期証券買入	15,000	2021/2/24			43,600	15,003	0.002		0.003	24.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2021/2/24			5,602	1,203	0.014		0.015	43.9
国債買入(残存期間25年超)	300	2021/2/24			1,572	301	0.015		0.015	97.7
国債買入(変動利付債)	500	2021/2/24			1,016	500	▲0.410		▲0.499	60.0
国債買入(物価連動債)	300	2021/2/24			1,675	303	▲0.160		▲0.183	86.8
CP等買入	5,000	2021/2/26			7,287	4,992	▲0.036		▲0.031	66.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/22	2021/2/24	▲0.350	211	211		▲0.350	▲0.366	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/22	2021/2/24	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	

●2021年2月23日の予定

*天皇誕生日

*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*1月の消費者物価指数改定値

●2021年2月24日の予定

*米国1月の新築一戸建て販売件数
*米国2月のCB消費者信頼感指数

*国庫短期証券(975回)入札(6ヶ月、34,000億円、2/25発行)
*流動性供給入札(5,000億円、2/25発行)

◆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