

Central Daily Market Report

2021年2月24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24日		2021年2月25日		2021年2月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,500		▲ 800	
財政	▲ 1,800		▲ 5,900		8,800	
資金過不足	▲ 2,500		▲ 7,400		8,000	
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			4,000	▲ 3,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	15,000					
国債買入	2,300					
CP等買入		▲ 500		▲ 1,300	5,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 183,000
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 500	200		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	14,000		▲ 7,800		▲ 170,000	
当座預金残高	4,927,800		4,920,000		4,750,000	
準備預金残高	4,334,400					
積み終了先	4,334,100		2月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,334,100		積数		2,100	
非準備預金先	593,400		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	99.94%	日数	32.14%		

●2021年2月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.05~▲0.005%の出合い。引き続き地銀業態を中心に調達意欲は強く、横ばい圏で推移した。一巡後は▲0.06~▲0.03%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見られた。

<レポ市場>

GC T/N(2/25-2/26)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TB6M物(975回)の入札が実施された。WI取引において▲0.106%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1088%、按分落札利回▲0.1068%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、▲0.120%出合いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は月末発行にあたり輸送機器、建設業態等で大型発行が実施された。償還総額1兆1,800億円程度に対して、発行総額は3,800億円程度と大幅な償還超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/2/24	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	▲ 0.020				-	▲ 0.084	0.115	0.000	29,671.70	▲ 484.33	105.29-30	105.56-58
T/N	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.009				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.010	0.040	0.000				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.095						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.099						
3M	0.070	0.100	0.095				▲ 0.104	▲ 0.102						
6M							▲ 0.120	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.139						
									日付	2/16	2/17	2/18	2/19	2/22
									日銀当預残	4,946,000	4,930,200	4,937,500	4,935,500	4,913,800
									準備預金残	4,333,200	4,322,400	4,339,100	4,333,700	4,329,200
									マネタリーベース	6,148,200	6,132,800	6,141,200	6,140,100	6,119,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.019%	▲ 0.020%
									コール市場残高	135,313	136,737	130,887	158,386	150,927
									うち無担	114,899	116,889	110,927	137,797	130,885
									うちO/N	70,936	69,406	62,614	81,924	74,572
									うち有担	20,414	19,848	19,960	20,589	20,042

●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	975	-	34,000	2021/2/25	2021/8/25	123,889.8	27,716.2	100.0530	▲0.1068%	28.2398%	100.0540	▲0.1088%	6,283.0
流動性供給	328	-	5,000	2021/2/25		25,226.0	4,985.0		0.0020%	36.3391%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2021/2/25	2021/3/10		3,951	3,951				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/24	2021/2/25	▲ 0.350	532	532		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/24	2021/2/25	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/2/26	2021/3/4	0.320	2	2				
米ドル資金供給		2021/2/26	2021/5/20	0.320	0	0				
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数					
成長基盤強化	本則第43回	2021/3/3	0	6,793	16					
成長基盤強化	米ドル特別第35期	2021/3/5		2,321	19					
成長基盤強化	米ドル特別第31期(借り換え)	2021/3/5		122	22					
成長基盤強化	米ドル特別第27期(借り換え)	2021/3/5		502	16					
成長基盤強化	米ドル特別第23期(借り換え)	2021/3/5		1,109	17					

●2021年2月25日の予定

*12月の景気動向指数改訂状況	*米国10-12月期のGDP改定値	*交付税特別会計借入(10,500億円、3/5借入)
	*米国1月の耐久財新規受注	

◆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