

# Central Daily Market Report

2021年2月25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25日		2021年2月26日		2021年3月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 700			0
財政	▲ 5,400		11,800		▲ 28,000	
資金過不足	▲ 6,900		11,100		▲ 28,000	
<b>金融調節</b>	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						
国債買入			13,000			
CP等買入		▲ 1,300	5,000	▲ 7,200		
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			178,800	▲ 182,900		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	500		300		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増増減	▲ 7,600		18,100		▲ 28,000	
当座預金残高	4,920,200		4,938,300		4,910,300	
準備預金残高	4,301,900					
積み終了先	4,301,500		2月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,301,500		積数	1,700		
非準備預金先	618,300		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	99.95%	日数	35.71%		

## ●2021年2月25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~▲0.004%の出合い。動向に大きな変化は無く、前日とほぼ同水準での取引となった。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。ターム物はオファーが少ない中、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(2/26-3/1)は、▲0.095~▲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>

本日のアウトライイト市場は、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発行市場は鉄鋼、石油・石炭業態で大型発行が実施された。償還総額400億円程度に対して、発行総額は1,800億円程度と発行超となった。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

2021/2/25	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.022				-	▲ 0.087	0.140	0.025	30,168.27	496.57	105.95-96	106.00-02
T/N	▲ 0.035	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.094						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W	▲ 0.008	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.093						
2W			▲ 0.018				-	▲ 0.094						
3W			0.001				-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.098						
3M			0.030				▲ 0.104	▲ 0.102						
6M							▲ 0.120	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	2/17	2/18	2/19	2/22	2/24
									日銀当預残	4,930,200	4,937,500	4,935,500	4,913,800	4,927,800
									準備預金残	4,322,400	4,339,100	4,333,700	4,329,200	4,334,800
									マネタリーベース	6,132,800	6,141,200	6,140,100	6,119,300	6,134,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.019%	▲ 0.020%	▲ 0.020%
									コール市場残高	136,737	130,887	158,386	150,927	144,490
									うち無担	116,889	110,927	137,797	130,885	124,138
									うちO/N	69,406	62,614	81,924	74,572	75,500
									うち有担	19,848	19,960	20,589	20,042	20,352

## ●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)
交付税特会	-	-	10,500	2021/3/5	2021/9/2	359,260.0	10,500.26		0.0000%	2.9228%		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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2021/2/26			3,427	1,001	0.006		0.011	89.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/2/26			7,464	4,003	0.005		0.007	1.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/2/26			13,514	3,705	0.012		0.017	13.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/2/26			9,964	4,201	0.016		0.017	20.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/25	2021/2/26	▲ 0.350	288	288		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/25	2021/2/26	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/2/26時点の貸出残高(億円)					
新型コロナ対応金融支援特別	2021/2/26	2021/8/26	0	178,756	561,440					

## ●2021年2月26日の予定

*2月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.4%)	*米国1月の個人所得・消費支出 *米国2月のシカゴPM景況感指数	*国庫短期証券(976回)入札 (3ヶ月、67,000億円、3/1発行) *2年利付国債入札 (30,000億円、3/1発行)
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 (市場予想:前月比+4.0%)	*1月の商業動態統計速報	*1月の住宅着工統計

◆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