

# Central Daily Market Report

2021年2月1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1日 需給速報	2021年2月2日 需給予想	2021年2月3日 当社予想
銀行券	600	700	0
財政	▲ 26,700	▲ 18,200	▲ 90,000
資金過不足	▲ 26,100	▲ 17,500	▲ 90,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
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	8,900		
CP等買入		▲ 100	
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			
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供給			
当預増減	▲ 17,300	▲ 17,400	▲ 90,000
当座預金残高	4,941,700	4,924,300	4,834,300
準備預金残高	4,366,400		
積み終了先	4,366,400		2月2日以降の残り所要積立額
超過準備	4,366,400		積数
非準備預金先	575,300		1日平均
			300
			0
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,604,600
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			54.84%

## ●2021年2月1日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.03~▲0.005%の出合いが始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いが見られた程度で、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>

GC T/N(2/2-2/3)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、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市場は、償還300億円に対して、発行件数は少なく閑散としていた。発行レートは、引き続きマイナス圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/2/1	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.082	0.055	0.005	28,091.05	427.66	104.70-72	104.74-75
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.030	0.003				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.018	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.086						
3W			0.010				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.015	0.050	0.007				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.105	▲ 0.099						
6M							▲ 0.110	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.139						
									日付	1/25	1/26	1/27	1/28	1/29
									日銀当預残	4,857,200	4,874,100	4,941,900	4,947,800	4,959,000
									準備預金残	4,289,500	4,298,200	4,349,400	4,353,400	4,354,800
									マネタリーベース	6,063,200	6,079,700	6,147,900	6,154,100	6,165,300
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.016%	▲0.017%	▲0.016%	▲0.012%
									コール市場残高	143,033	128,862	135,232	129,670	124,695
									うち無担	121,892	107,646	113,824	108,897	104,323
									うちO/N	69,554	63,258	69,361	64,684	60,740
									うち有担	21,141	21,216	21,408	20,773	20,372

## ●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/1	2021/2/2	▲ 0.350	142	142		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/1	2021/2/2	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年2月2日の予定

*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支	*ユーロ圏10-12月期のGDP1次速報	*10年利付国債入札(26,000億円、2/3発行)
*1月のマネタリーベース		

◆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