

# Central Daily Market Report

2021年2月8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8日 需給速報	2021年2月9日 需給予想	2021年2月10日 当社予想
銀行券	300	▲ 100	0
財政	▲ 7,400	▲ 2,200	▲ 9,000
資金過不足	▲ 7,100	▲ 2,300	▲ 9,000
<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	6,700		
CP等買入		▲ 100	▲ 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	3,000		
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
E T F 買入	600	100	
国債補充供給	▲ 400	400	400
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>			
当預増減	3,100	▲ 2,000	▲ 9,000
当座預金残高	4,859,400	4,857,400	4,848,400
準備預金残高	4,301,700		
積み終了先	4,301,700	2月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,301,700	積数	100
非準備預金先	557,700	1日平均	0
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,617,200
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			77.42%

## ●2021年2月8日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.03~▲0.005%での調達で始まった。週末要因の剥落等から出合いレートは若干低下したものの、積み終盤ということもあって引き続き調達ニーズは強かった。一巡後も▲0.01~▲0.008%と高い水準で推移し取引を終了した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(2/9~2/10)は、▲0.085~▲0.080%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2Y410~421、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、3M物が▲0.105~▲0.104%で出合った。

### <CP市場>

CP市場は、建設業態で大型発行があり、償還総額は1,300億円程度に対し発行総額は650億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/2/8	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.081	0.065	0.010	29,388.50	609.31	105.39~40	105.48~49
T/N	▲ 0.007	▲ 0.001	▲ 0.002					-	▲ 0.086						
S/N	▲ 0.007	▲ 0.006	▲ 0.007					-	-						
1W								-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.007	▲ 0.005	▲ 0.006					-	▲ 0.087						
3W								-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.013					-	▲ 0.093						
3M								▲ 0.105	▲ 0.100						
6M								▲ 0.110	▲ 0.110						
1Y								▲ 0.127	▲ 0.139						
										日付	2/1	2/2	2/3	2/4	2/5
										日銀当預残	4,941,700	4,925,600	4,854,300	4,862,000	4,856,300
										準備預金残	4,363,000	4,336,800	4,298,300	4,287,800	4,295,700
										マネタリーベース	6,147,400	6,130,600	6,058,700	6,066,300	6,059,900
										無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.013%	▲0.013%	▲0.011%	▲0.010%
										コール市場残高	127,946	122,360	129,297	128,960	147,545
										うち無担	107,757	101,612	106,416	107,886	126,498
										うちO/N	64,434	58,089	61,583	63,733	68,335
										うち有担	20,189	20,748	22,881	21,074	21,047

## ●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)
物価連動10年	25	0.20%	2,000	2021/2/9	2030/3/10	6,133.0	1,998.00	102.9500	▲0.1210%	51.0638%			

## ●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)		2021/2/8	2021/2/9	▲ 0.350	421	421		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/8	2021/2/9	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年2月9日の予定

*12月の毎月勤労統計調査速報	*国庫短期証券(971回)入札
*1月のマネーストック	(6ヶ月、34,000億円、2/10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お客様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