

Central Daily Market Report

2021年2月15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15日 需給速報	2021年2月16日 需給予想	2021年2月17日 当社予想
銀行券	200	700	▲ 1,000
財政	54,900	3,400	▲ 29,000
資金過不足	55,100	4,100	▲ 30,000
金融調節			
	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		12,400	
CP等買入	6,000	▲ 800	▲ 300
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			
国債補完供給	▲ 200	1,100	200
*ドル資金供給用担保確保供給			
当預増減	61,200	16,400	▲ 30,000
当座預金残高	4,931,100	4,947,500	4,917,500
準備預金残高	4,369,200		
積み終了先	4,369,200		2月16日以降の残り所要積立額
超過準備	4,369,200		積数
非準備預金先	561,900		1日平均
			3,263,100
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	0.00%	日数
			0.00%

●2021年2月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日にあたることから、前営業日に引き続き高い水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.01~▲0.003%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.05~▲0.005%のレンジの出会いで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(2/16-2/17)は、▲0.090~▲0.080%程度での出会い。SCはローラー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、6M物が▲0.120~▲0.117%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額100億円程度に対して、発行総額は300億円程度と若干の発行超であった。小型案件を中心とする閑散としたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/2/15	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	
	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)
単位：%									0.075	0.015	30,084.15	564.08	105.06-07	105.17-18
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.078						
T/N	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.018				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.088						
3W	0.001	0.040	0.021				-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.005	0.015	0.009				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.108	▲ 0.100						
6M							▲ 0.117	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.133	▲ 0.138						
									日付	2/5	2/8	2/9	2/10	2/12
									日銀当預残	4,856,300	4,859,400	4,856,800	4,861,200	4,869,900
									準備預金残	4,295,700	4,302,400	4,294,200	4,311,200	4,296,900
									マネタリーベース	6,059,900	6,062,600	6,060,200	6,064,600	6,072,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.008%	▲ 0.011%
									コール市場残高	147,545	126,524	123,820	118,196	131,346
									うち無担	126,498	105,861	102,598	97,291	109,620
									うちO/N	68,335	51,478	56,365	51,858	65,617
									うち有担	21,047	20,663	21,222	20,905	21,726

●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	案分率	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,000	2021/2/16			13,253	4,005	0.003		0.005	25.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,700	2021/2/16			11,655	3,706	0.006		0.007	58.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/2/16			10,108	4,211	0.011		0.012	28.2
国債買入(物価連動債)	300	2021/2/16			1,018	301	▲ 0.100		▲ 0.179	4.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/15	2021/2/16	▲ 0.350	149	149		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/15	2021/2/16	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年2月16日の予定

*12月の第3次産業活動指数	*ユーロ圏10-12月期のGDP2次速報	*5年利付国債入札(25,000億円、2/17発行)
		*国有林野借入(959億円、2/25借入)

◆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