

Central Daily Market Report

2021年2月26日(金)
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26日		2021年3月1日		2021年3月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 200			0
財政	12,600		▲ 33,100		▲ 17,000	
資金過不足	11,800		▲ 33,300		▲ 17,000	
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						
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	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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別	178,800	▲ 182,900				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300	300		300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	18,500		▲ 33,000		▲ 17,000	
当座預金残高	4,938,700		4,905,700		4,888,700	
準備預金残高	4,326,100					
積み終了先	4,325,700				3月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,325,700				積数	800
非準備預金先	612,600				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	99.98%	日数	46.43%		

●2021年2月26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▲0.040~▲0.003%の出会い。都銀業態では取り上がる動きが見られたものの、地銀業態では調達レートを切り下げの動きも見られた。一巡後は▲0.075~▲0.008%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は今積み期内物を中心に出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(3/1-3/2)は、▲0.09~▲0.08%程度での出会い。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>

本日はTB3M物(976回)の入札が実施された。WI取引において▲0.102~▲0.100%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1050%、按分落札利回▲0.1023%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、▲0.110%出会いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は100億円程度と償還超となった。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

2021/2/26	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	▲ 0.100	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.088	0.160	0.020	28,966.01	▲ 1,202.26	106.38-39	106.08-09
T/N	▲ 0.028	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.095						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W			▲ 0.009				-	▲ 0.093						
2W			0.001				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.095						
1M	0.001	0.070	0.032				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.110	▲ 0.104						
6M							▲ 0.120	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.138						
									日付	2/18	2/19	2/22	2/24	2/25
									日銀当預残	4,937,500	4,935,500	4,913,800	4,927,800	4,920,200
									準備預金残	4,339,100	4,333,700	4,329,200	4,334,800	4,301,900
									マネタリーベース	6,141,200	6,140,100	6,119,300	6,134,000	6,127,800
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.019%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.022%
									コール市場残高	130,887	158,386	150,927	144,490	147,992
									うち無担	110,927	137,797	130,885	124,138	127,433
									うちO/N	62,614	81,924	74,572	75,500	78,975
									うち有担	19,960	20,589	20,042	20,352	20,559

●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	976	-	67,000	2021/3/1	2021/6/7	195,998.8	54,619.30	100.0275	▲0.1023%	69.9421%	100.0282	▲0.1050%	12,380.0
2年利付国債	422	0.10%	30,000	2021/3/1	2023/3/1	105,003.0	24,564.0	100.3950	▲0.0970%	26.5444%	100.3990	▲0.0990%	5,430.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/2/26	2021/3/1	▲0.350	253	253		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/2/26	2021/3/1	▲0.350	0	0				

●2021年3月1日の予定

- *米国1月の建設支出
- *米国2月のISM製造業景況指数

◆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