

Central Daily Market Report

2021年1月4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1月4日		2021年1月5日		2021年1月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,400		3,200		5,000	
財政	▲16,200		▲3,700		▲53,000	
資金過不足	▲12,800		▲500		▲48,000	
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						
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						
国債補完供給	▲200	3,200		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲9,800		▲400		▲48,000	
当座預金残高	4,932,500		4,932,100		4,884,100	
準備預金残高	4,351,300					
積み終了先	4,351,300		1月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,351,300		積数		100	
非準備預金先	581,200		1日平均		0	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,581,400	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	64.52%		

●2021年1月4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・証券業態を中心に▲0.04~▲0.01%の出合いとなった。年末初の動きから調達を控えていた先も、再び資金調達に動く姿が散見された。一巡後もビッドは底堅く、レートの低下は限定的で▲0.04~▲0.015%の出合いが見られた。ターム物は四半期末でエンドを迎えた先から取引を再開する動きが見られ、ショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(1/5-1/6)は、▲0.09~▲0.075%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2Y410~419、5Y136~145、10Y345~360、20Y167~174、30Y59~68、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>

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150億円程度に対して、発行総額は950億円程度と発行超であった。一部の卸売業態において大型発行が見られたものの、案件は少なく、閑散としたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/4	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	▲0.070	0.001	▲0.018				-	▲0.075	0.020	0.000	27,258.38	▲185.79	103.24~26	102.91~93
T/N			▲0.001				-	▲0.078						
S/N							-	-						
1W	▲0.019	▲0.010	▲0.014				-	▲0.079						
2W	▲0.040	▲0.001	▲0.017				-	▲0.082						
3W							-	▲0.087						
1M	▲0.040	0.200	▲0.006				-	▲0.093						
3M							▲0.103	▲0.099						
6M							▲0.107	▲0.117						
1Y							▲0.117	▲0.144						
									日付	12/24	12/25	12/28	12/29	12/30
									日銀当預残	4,946,400	4,952,000	4,956,200	4,946,400	4,942,300
									準備預金残	4,333,600	4,362,700	4,348,600	4,363,200	4,330,300
									マネタリーベース	6,171,000	6,179,600	6,186,900	6,179,900	6,176,100
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.016%	▲0.019%	▲0.019%	▲0.033%
									コール市場残高	137,015	139,994	133,408	134,717	105,750
									うち無担	113,897	118,031	109,685	113,037	85,785
									うちO/N	67,119	72,503	66,007	70,244	59,417
									うち有担	23,118	21,963	23,723	21,680	19,965

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/4	2021/1/5	▲0.350	191	191		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/4	2021/1/5	▲0.350	0	0				

●2021年1月5日の予定

*12月実績/1月見込み財政資金対民間収支 *12月のマネタリーベース	*米国12月のISM製造業景況指数	*国庫短期証券(962回)入札 (3ヶ月、73,000億円、1/6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