

Central Daily Market Report

2021年1月5日(火)

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5日		2021年1月6日		2021年1月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,300		2,100		3,000	
財政	▲1,000		▲54,300		▲24,000	
資金過不足	2,300		▲52,200		▲21,000	
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			13,200			
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	▲400	200		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	2,000		▲38,600		▲21,000	
当座預金残高	4,934,500		4,895,900		4,874,900	
準備預金残高	4,325,600					
積み終了先	4,325,600		1月6日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,325,600		積数		100	
非準備預金先	608,900		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	67.74%		

●2021年1月5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。参加者の動向に大きな変化は無く、前日とほぼ同水準での取引となり、一巡後もほぼ同水準で推移し▲0.04~▲0.015%の出合いが見られた。ターム物は、ショートターム物でロール案件が中心の取引が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/6-1/7)は、▲0.08~▲0.07%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>

本日はTB3M物(962回)の入札が実施された。WI取引において▲0.090~▲0.085%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0861%、按分落札利回▲0.0820%と、やや軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.083%出合いが見られた。

<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50億円程度に対して、発行総額は1,450億円程度と大きく発行超であった。一部の卸売業態において大型発行が見られるなど、やや活況なマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/5	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	
	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	▲0.065	0.001	▲0.019				-	▲0.081	0.010	▲0.010	27,158.63	▲99.75	103.13-14	102.93-95
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003				-	▲0.076						
S/N							-	-						
1W	▲0.015	0.000	▲0.013				-	▲0.079						
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.013				-	▲0.082						
3W			0.030				-	▲0.086						
1M	▲0.020	0.480	▲0.001				-	▲0.091						
3M							▲0.083	▲0.099						
6M							▲0.107	▲0.118						
1Y							▲0.117	▲0.143						
									日付	12/25	12/28	12/29	12/30	1/4
									日銀当預残	4,952,000	4,956,200	4,946,400	4,942,300	4,932,500
									準備預金残	4,362,700	4,348,600	4,363,200	4,330,300	4,350,600
									マネタリーベース	6,179,600	6,186,900	6,179,900	6,176,100	6,162,800
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.019%	▲0.019%	▲0.033%	▲0.018%
									コール市場残高	139,994	133,408	134,717	105,750	124,609
									うち無担	118,031	109,685	113,037	85,785	103,899
									うちO/N	72,503	66,007	70,244	59,417	71,761
									うち有担	21,963	23,723	21,680	19,965	20,710

●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	962	-	73,000	2021/1/6	2021/4/5	169,654.1	59,400.4	100.0200	▲0.0820%	82.5825%	100.0210	▲0.0861%	13,599.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/1/6			9,515	4,503	▲0.003		▲0.002	69.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2021/1/6			7,851	4,204	▲0.009		▲0.008	14.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/1/6			10,224	4,207	▲0.008		▲0.007	50.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/5	2021/1/6	▲0.350	354	354		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/5	2021/1/6	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/1/7	2021/1/14	0.330	0	0				
米ドル資金供給		2021/1/7	2021/4/1	0.330	0	0				

●2021年1月6日の予定

*12月の消費動向調査	*米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(26,000億円、1/7発行)
*1月の日銀当座預金増減要因見込み		*交付税特別会計借入(10,950億円、1/15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