

# Central Daily Market Report

2021年1月6日(水)  
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6日		2021年1月7日		2021年1月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,200		2,000		2,000	
財政	▲ 53,500		▲ 21,100		0	
資金過不足	▲ 51,300		▲ 19,100		2,000	
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			10,000			
国債買入	13,200					
CP等買入						
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			100			
国債補完供給		400				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 37,700		▲ 9,000		2,000	
当座預金残高	4,896,800		4,887,800		4,889,800	
準備預金残高	4,315,100					
積み終了先	4,315,100		1月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,315,100		積数		100	
非準備預金先	581,700		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	70.97%		

## ●2021年1月6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▲0.035~▲0.01%の出会いとなった。調達ニーズは強く、概ね昨日と横ばいで推移した。一巡後は▲0.035~▲0.013%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は月内物の引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(1/7-1/8)は、▲0.10~▲0.075%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2Y410~419、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、短国買入オペが10,000億円度でオファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差+0.002%と、やや弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.084%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1,000億円程度に対して、発行総額は3,000億円程度と大きく発行超であった。複数業態において大型発行が見られ、案件数が膨らみ活況なマーケットであった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/1/6	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	▲ 0.018				-	▲ 0.074	0.025	0.015	27,055.94	▲ 102.69	102.68-70	102.74-75
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.013	0.020	0.002				-	▲ 0.078						
2W	▲ 0.013	▲ 0.003	▲ 0.010				-	▲ 0.082						
3W	▲ 0.003	0.020	0.005				-	▲ 0.086						
1M	▲ 0.015	0.020	▲ 0.006				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.084	▲ 0.099						
6M							▲ 0.107	▲ 0.118						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.143						
									日付	12/28	12/29	12/30	1/4	1/5
									日銀当預残	4,956,200	4,946,400	4,942,300	4,932,500	4,934,500
									準備預金残	4,348,600	4,363,200	4,330,300	4,350,600	4,326,300
									マネタリーベース	6,186,900	6,179,900	6,176,100	6,162,800	6,161,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.019%	▲ 0.033%	▲ 0.018%	▲ 0.019%
									コール市場残高	133,408	134,717	105,750	124,609	118,410
									うち無担	109,685	113,037	85,785	103,899	97,122
									うちO/N	66,007	70,244	59,417	71,761	62,669
									うち有担	23,723	21,680	19,965	20,710	21,288

## ●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)
10年利付国債	361	0.10%	26,000	2021/1/7	2030/12/20	71,842.0	21,103.0	100.7700	0.0220%	32.9842%	100.8000	0.0190%	4,873.0
交付税特会	-	-	10,950	2021/1/15	2021/7/16	346,742.0	10,950.03		0.0000%	3.1580%		0.0000%	

## ●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
国庫短期証券買入	10,000	2021/1/7			28,699	10,003	0.002		0.003	6.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/6	2021/1/7	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/6	2021/1/7	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年1月7日の予定

*11月の毎月勤労統計調査速報	*米国11月の貿易収支 *米国12月のISM 非製造業景況指数 *ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値	*国庫短期証券(963回)入札 (6ヶ月、38,000億円、1/12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