Central Daily Market Report

2021年1月7日（木）
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7日 需給速報		2021年1月8日 需給予想		2021年1月12日 当社予想	
銀行券	2,100		2,200		4,000	
財政	▲ 18,000		4,700		▲ 35,000	
資金過不足	▲ 15,900		6,900		▲ 31,000	
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						
CP等買入				▲ 400		
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						
ＥＴＦ買入	100		100			
国債補完供給	▲ 500			500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 6,300		7,100		▲ 31,000	

当座預金残高	4,890,500	4,897,600	4,866,600
準備預金残高	4,311,900		
積み終了先	4,311,900		
超過準備	4,311,900		
非準備預金先	578,600		

1月8日以降の残り所要積立額	
積数	100
1日平均	0

積み期間（12/16～1/15）の所要準備額	3,592,300

準備預金進捗率	実績 100.00%	日数	74.19%

●2021年1月7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。引き続き資金調達意欲が強く、高い水準での取引が中心となった。一巡後は▲0.04～▲0.015%で散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては特段目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(1/8-1/12)は、▲0.08～▲0.09%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TB6M物（963回）の入札が実施された。WI取引において▲0.083～▲0.080%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.0886%、按分落札利回▲0.0866%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.092～▲0.090%出合いと、やや堅調に推移した。

<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250億円程度に対して、発行総額は2,600億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

2021/1/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.018				－	▲ 0.081
T/N	▲ 0.040	▲ 0.001	▲ 0.004				－	▲ 0.085
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.014				－	▲ 0.080
2W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.020				－	▲ 0.081
3W							－	▲ 0.087
1M							－	▲ 0.092
3M							▲ 0.084	▲ 0.099
6M							▲ 0.092	▲ 0.116
1Y							▲ 0.117	▲ 0.143

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.035	0.010	27,490.13	434.19	103.02-03	103.36-37

日付	12/29	12/30	1/4	1/5	1/6
日銀当預残	4,946,400	4,942,300	4,932,500	4,934,500	4,896,800
準備預金残	4,363,200	4,330,300	4,350,600	4,326,300	4,315,100
マネタリーベース	6,179,900	6,176,100	6,162,800	6,161,500	6,121,600
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.033%	▲0.018%	▲0.019%	▲0.018%
コール市場残高	134,717	105,750	124,609	118,410	120,327
うち無担	113,037	85,785	103,899	97,122	98,967
うちO/N	70,244	59,417	71,761	62,669	62,814
うち有担	21,680	19,965	20,710	21,288	21,360

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	963	－	38,000	2021/1/12	2021/7/12	125,642.0	30,949.4	100.0430	**▲0.0866%**	**48.6755%**	100.0440	**▲0.0886%**	7,050.0

●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）		2021/1/7	2021/1/8	▲ 0.350	70	70		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/1/7	2021/1/8	▲ 0.350	460	460		▲0.350	▲0.350	
社債等買入（残存期間1年以上3年以下）	3000	2021/1/13			5,754	3,001	▲0.032		▲0.018	92.9

●2021年1月8日の予定

*11月の全世帯家計調査（市場予想：消費支出、前年比▲1.5%）
*11月の景気動向指数速報
*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国11月の卸売売上高
*米国11月の消費者信用残高
*米国12月の雇用統計
*国庫短期証券（964回）入札
（3ヶ月、73,000億円、1/12発行）
*30年利付国債入札
（9,000億円、1/12発行）
*エネルギー対策借入
（5,500億円、1/20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。
◆本資料は何ら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論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