

Central Daily Market Report

2021年1月8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1月8日		2021年1月12日		2021年1月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,300		2,300		3,000	
財政	2,200		▲ 35,400		0	
資金過不足	4,500		▲ 33,100		3,000	
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						▲ 4,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 400		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					3,000	
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	▲ 200	500		200		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	4,500		▲ 33,400		1,300	
当座預金残高	4,895,000		4,861,600		4,862,900	
準備預金残高	4,301,200					
積み終了先	4,301,200				1月12日以降の残所要積立額	
超過準備	4,301,200				積数	0
非準備預金先	593,800				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	87.10%

●2021年1月8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~▲0.008%の出会いとなった。連休を跨ぎ取引であることから、一部取り上がる先も見られた。一巡後も同水準で推移し、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/12-1/13)は、▲0.085~▲0.075%程度での出会い。SCはローラー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(964回)の入札が実施された。WI取引において▲0.094~▲0.087%での出会いが見られたものの、平均落札利回▲0.0883%、按分落札利回▲0.0851%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、▲0.089~▲0.087%出合いと、入札と同水準で推移した。この他に、6M物が▲0.100%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250億円程度に対して、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、案件数が膨らむなど、活況なマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/8	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.082	0.035	0.000	28,139.03	648.90	103.80-81	103.97-98		
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.077								
S/N							-	-								
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.080								
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.083								
3W							-	▲ 0.087								
1M							-	▲ 0.091								
3M							▲ 0.089	▲ 0.099								
6M							▲ 0.100	▲ 0.116								
1Y							▲ 0.120	▲ 0.143								
											日付	12/30	1/4	1/5	1/6	1/7
											日銀当預残	4,942,300	4,932,500	4,934,500	4,896,800	4,890,500
											準備預金残	4,330,300	4,350,600	4,326,300	4,315,100	4,313,400
											マネタリーベース	6,176,100	6,162,800	6,161,500	6,121,600	6,113,200
											無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.018%	▲0.019%	▲0.018%	▲0.018%
											コール市場残高	105,750	124,609	118,410	120,327	117,958
											うち無担	85,785	103,899	97,122	98,967	98,186
											うちO/N	59,417	71,761	62,669	62,814	60,703
											うち有担	19,965	20,710	21,288	21,360	19,772

●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	964	-	73,000	2021/1/12	2021/4/12	184,320.9	59,351.3	100.0210	▲0.0851%	53.1682%	100.0218	▲0.0883%	13,648.0
30年利付国債	69	0.70%	9,000	2021/1/12	2050/12/20	21,756.0	7,308.0	101.2000	0.6520%	37.7084%	101.3000	0.6480%	1,680.0
エネルギー対策	-	-	5,500	2021/1/20	2022/1/20	149,312.0	5,499.85		0.0000%	3.6836%		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	申込総額(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)		2021/1/8	2021/1/12	▲ 0.350	229	229		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/8	2021/1/12	▲ 0.350	0	0				

●2021年1月12日の予定

- *11月の国際収支
- *12月の景気ウォッチャー調査

◆本資料は信頼できるとさ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