

Central Daily Market Report

2021年1月12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12日 需給速報	2021年1月13日 需給予想	2021年1月14日 当社予想
銀行券	2,300	2,700	3,000
財政	▲ 34,500	100	▲ 34,000
資金過不足	▲ 32,200	2,800	▲ 31,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			4,100 ▲ 4,700
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		11,500	
CP等買入	▲ 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	▲ 400	200	400
※ドル資金供給用担保提供供給			
当増減	▲ 32,900	17,200	▲ 31,000
当座預金残高	4,862,100	4,879,300	4,848,300
準備預金残高	4,318,300		
積み終了先	4,318,300		1月13日以降の残り所要積立額
超過準備	4,318,300		積数
非準備預金先	543,800		1日平均
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
			90.32%

●2021年1月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因の剥落により一部ではレートを引き下げる先も見られたものの、全体的には資金調達ニーズは堅調で、前営業日比ほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは地銀・証券業態などから▲0.03~▲0.008%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.05~▲0.008%で出合いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(1/13-1/14)は、▲0.075~▲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2Y410~420、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、3M物が▲0.090%、6M物が▲0.109%、1Y物が▲0.120%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、卸売業態で大型発行があり、償還総額は200億円程度に対し発行総額は1,600億円程度。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/12	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	
	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.077	0.030	▲ 0.005	28,164.34	25.31	104.13-14	104.15-17
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.080						
2W	▲ 0.013	0.010	▲ 0.004				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.088						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.090	▲ 0.100						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.143						
									日付	1/4	1/5	1/6	1/7	1/8
									日銀当預残	4,932,500	4,934,500	4,896,800	4,890,500	4,895,000
									準備預金残	4,350,600	4,326,300	4,315,100	4,313,400	4,301,100
									マネタリーベース	6,162,800	6,161,500	6,121,600	6,113,200	6,115,400
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.019%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.016%
									コール市場残高	124,609	118,410	120,327	117,958	125,806
									うち無担	103,899	97,122	98,967	98,186	105,110
									うちO/N	71,761	62,669	62,814	60,703	67,977
									うち有担	20,710	21,288	21,360	19,772	20,696

●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	案分率	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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2021/1/13	2021/1/28		4,051	4,051				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2021/1/13			1,758	1,501	▲0.015		0.001	44.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2021/1/13			7,132	4,202	▲0.004		0.001	65.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/1/13			5,842	4,204	0.001		0.003	94.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2021/1/13			5,765	1,206	0.008		0.009	31.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/12	2021/1/13	▲ 0.350	341	341		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/12	2021/1/13	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/1/14	2021/1/22	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2021/1/14	2021/4/8	0.330	0	0				

●2021年1月13日の予定

*11月の特定サービス産業動態統計速報	*米国ページブック	*5年利付国債入札(25,000億円、1/14発行)
*12月のマネーストック	*米国12月の財政収支	*交付税特別会計借入(10,000億円、1/22借入)
	*米国12月の消費物価指数	

◆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お客様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