

Central Daily Market Report

2021年1月14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14日 | | 2021年1月15日 | | 2021年1月18日 | |
|------------------------|------------|---------|------------|--------|-----------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 1,700 | | 2,000 | | 2,000 | |
| 財政 | ▲ 27,600 | | 2,200 | | ▲ 14,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 25,900 | | 4,200 | | ▲ 12,000 | |
| 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 | 15,000 | | | | | |
| 国債買入 | | | 5,100 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | ▲ 1,400 | | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | 200 | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| 新型コロナ対応金融支援特別 | | | | | | |
| E T F 買入 | 500 | | 100 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | 300 | | 300 | | |
| ※ドル資金供給用担保確保供給 | | | | | | |
| 当増減 | ▲ 10,700 | | 8,500 | | ▲ 12,000 | |
| 当座預金残高 | 4,867,400 | | 4,875,900 | | 4,863,900 | |
| 準備預金残高 | 4,321,400 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,321,400 | | | | 1月15日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,321,400 | | | | 積数 | 0 |
| 非準備預金先 | 546,000 | | | | 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 | 96.77% | | |

●2021年1月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日を翌日に控えて資金調達ニーズがより一層高まり、昨日より高い水準での取引となった。立ち上がりは、都銀・地銀・証券業態などから▲0.01~▲0.002%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.05~▲0.005%のレンジの出会いで推移した。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>

GCT/N(1/15-1/18)は、▲0.085~▲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2Y410~420、5Y136~145、10Y345~360、20Y167~174、30Y59~69、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▲0.094%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、小玉案件中心で償還・発行共に400億円程度。発行レートは、概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入オペアが、予定通りの6,000億円で、下限レートが▲0.09%と前回比+1bpでオファーされた。平均落札レート▲0.026%、按分レート▲0.030%と、前回比で平均は低下、按分は上昇した。

●短期金融市場関連指標

| 2021/1/14 | 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) |
| O/N | ▲ 0.050 | 0.001 | ▲ 0.008 | | | | - | ▲ 0.074 | 0.030 | 0.005 | 28,698.26 | 241.67 | 103.83-84 | 104.03-04 |
| T/N | ▲ 0.010 | ▲ 0.001 | ▲ 0.003 | | | | - | ▲ 0.079 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | | | | | | | - | ▲ 0.080 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.020 | 0.010 | ▲ 0.006 | | | | - | ▲ 0.083 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.088 | | | | | | |
| 1M | ▲ 0.025 | 0.001 | ▲ 0.015 | | | | - | ▲ 0.092 | | | | | | |
| 3M | | | 0.080 | | | | ▲ 0.091 | ▲ 0.099 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.105 | ▲ 0.114 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.120 | ▲ 0.143 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 1/6 | 1/7 | 1/8 | 1/12 | 1/13 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 4,896,800 | 4,890,500 | 4,895,000 | 4,862,100 | 4,878,100 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 4,315,100 | 4,313,400 | 4,301,100 | 4,318,800 | 4,334,200 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 6,121,600 | 6,113,200 | 6,115,400 | 6,080,100 | 6,093,300 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.018% | ▲0.018% | ▲0.016% | ▲0.016% | ▲0.012% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 120,327 | 117,958 | 125,806 | 111,578 | 127,274 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 98,967 | 98,186 | 105,110 | 91,294 | 107,082 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 62,814 | 60,703 | 67,977 | 54,441 | 66,169 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 21,360 | 19,772 | 20,696 | 20,284 | 20,192 |

●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 | 応募総額(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 | 2021/1/15 | | | 10,497 | 4,503 | 0.002 | | 0.003 | 79.9 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 300 | 2021/1/15 | | | 1,721 | 303 | 0.008 | | 0.008 | 84.1 |
| 国債買入(物価連動債) | 300 | 2021/1/15 | | | 1,946 | 301 | ▲0.230 | | ▲0.248 | 66.4 |
| CP等買入 | 6,000 | 2021/1/19 | | | 11,638 | 5,993 | ▲0.030 | | ▲0.026 | 10.9 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2021/1/14 | 2021/1/15 | ▲0.350 | 257 | 257 | | ▲0.350 | ▲0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2021/1/14 | 2021/1/15 | ▲0.350 | 0 | 0 | | | | |

●2021年1月15日の予定

| | | |
|----------------|-----------------------|--------------------------------------|
| *11月の第3次産業活動指数 | *米国11月の企業在庫 | *国庫短期証券(965回)入札(3ヶ月、67,000億円、1/18発行) |
| | *米国12月の生産者物価指数 | *流動性供給入札(5,000億円、1/18発行) |
| | *米国12月の小売売上高 | *交付税特別会計借入(10,000億円、1/26借入) |
| | *米国12月の鉱工業生産・設備稼働率 | |
| | *米国1月のミシガン大消費者信頼感指数速報 | |

◆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