

# Central Daily Market Report

2021年1月15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15日 需給速報	2021年1月18日 需給予想	2021年1月19日 当社予想			
銀行券	2,000	1,600	2,000			
財政	3,600	▲ 13,800	4,000			
資金過不足	5,600	▲ 12,200	6,000			
<b>金融調節</b>						
	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						
国債買入	5,100					
CP等買入		▲ 1,400		▲ 600	6,000	
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				▲ 100		
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
E T F 買入	100		500			
国債補完供給	▲ 800	300		800		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	9,100	▲ 11,600			12,000	
当座預金残高	4,876,500	4,864,900			4,876,900	
準備預金残高	4,281,600					
積み終了先	4,281,600			1月18日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,281,600			積数	47,100	
非準備預金先	594,900			1日平均	1,600	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,604,600	
準備預金進捗率	実績	98.69%	日数	6.45%		

## ●2021年1月15日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、積み最終日にあたる一方で、次の積み期間にも掛かる取引となる事から調達を控える先も見られたため、昨日よりもやや低い水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.02~▲0.005%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.075~▲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＞

GC T/N(1/18-1/19)は、▲0.08~▲0.07%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＞

本日はTB3M物(965回)の入札が実施された。WI取引において▲0.094~▲0.092%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.0926%、按分落札利回▲0.0902%と、順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.100~▲0.094%出会いと、堅調に推移した。この他に1Y物が▲0.120%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、電力・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1,500億円程度となった。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

2021/1/15	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	
	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)
単位：%									0.030	0.000	28,519.18	▲ 179.08	103.83-85	103.69-71
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.096						
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.015	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.088						
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.092						
3M								▲ 0.096						
6M								▲ 0.105						
1Y								▲ 0.120						
日付		1/7	1/8	1/12	1/13	1/14								
日銀当預残	4,890,500	4,895,000	4,862,100	4,878,100	4,867,400									
準備預金残	4,313,400	4,301,100	4,318,800	4,334,200	4,321,400									
マネタリーベース	6,113,200	6,115,400	6,080,100	6,093,300	6,081,000									
無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.012%	▲ 0.008%									
コール市場残高	117,958	125,806	111,578	127,274	124,837									
うち無担	98,186	105,110	91,294	107,082	104,436									
うちO/N	60,703	67,977	54,441	66,169	62,023									
うち有担	19,772	20,696	20,284	20,192	20,401									

## ●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	965	-	67,000	2021/1/18	2021/4/19	182,926.9	54,468.2	100.0225	▲0.0902%	78.9288%	100.0231	▲0.0926%	12,531.0
流動性供給	325	-	5,000	2021/1/18		22,876.0	4,976.0		▲0.0080%	57.7176%		▲0.0080%	
交付税特会	-	-	10,000	2021/1/26	2021/7/28	371,441.0	10,000.20		0.0000%	2.6923%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/15	2021/1/18	▲ 0.350	701	701		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/15	2021/1/18	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年1月18日の予定

\*New York祝日  
(Martin L. King Jr.'s Day)

◆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