

# Central Daily Market Report

2021年1月18日(月)  
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18日		2021年1月19日		2021年1月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,500		1,800		1,000	
財政	▲ 18,400		1,000		▲ 28,000	
資金過不足	▲ 16,900		2,800		▲ 27,000	
<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			7,500			
国債買入						
CP等買入		▲ 600	6,000	▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	500		200			
国債補完供給	▲ 200	800		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
<b>当増減</b>	▲ 16,500		16,600		▲ 27,000	
当座預金残高	4,860,000		4,876,600		4,849,600	
準備預金残高	4,272,300					
積み終了先	4,257,800		1月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,241,100		積数		15,900	
非準備預金先	587,700		1日平均		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	99.56%	日数	9.68%		

## ●2021年1月18日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.065～▲0.010%の出合いが始まった。新積み期間に入り大手行の調達意欲は後退したものの、地銀業態の調達意欲は強く、概ね▲0.02～▲0.01%の出合いが中心となった。ターム物は、ショートターム物の引き合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(1/19-1/20)は、▲0.085～▲0.075%程度での出合い。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2Y410～420、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、短国買入オペアが前回から7,500億円減額の7,500億円でオファーされた。やや少なめの印象だったこともあり、平均落札利回り較差+0.004%、按分落札利回り較差+0.002%と、やや弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.102～▲0.100%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は小売・不動産業態において大型発行が実施された。償還総額1,100億円程度に対して、発行総額は2,100億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/1/18	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	
	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.082	0.045	0.015	28,242.21	▲ 276.97	103.91-92	103.75-77
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.011	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.020				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.093						
3M			0.080				▲ 0.100	▲ 0.099						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.141						
									日付	1/8	1/12	1/13	1/14	1/15
									日銀当預残	4,895,000	4,862,100	4,878,100	4,867,400	4,876,500
									準備預金残	4,301,100	4,318,800	4,334,200	4,321,400	4,281,600
									マネタリーベース	6,115,400	6,080,100	6,093,300	6,081,000	6,088,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.012%	▲ 0.008%	▲ 0.015%
									コール市場残高	125,806	111,578	127,274	124,837	115,964
									うち無担	105,110	91,294	107,082	104,436	97,521
									うちO/N	67,977	54,441	66,169	62,023	61,138
									うち有担	20,696	20,284	20,192	20,401	18,443

## ●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	募入最高利回り	業分率	募入平均価格	募入平均利回り	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
国庫短期証券買入	7,500	2021/1/19			25,626	7,501	0.002		0.004	81.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/18	2021/1/19	▲ 0.350	159	159		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/18	2021/1/19	▲ 0.350	0	0				

## ●2021年1月19日の予定

*11月の石油等消費動態統計	*国庫短期証券(966回)入札 (1年、35,000億円、1/20発行)	*20年利付国債入札 (12,000億円、1/20発行)
----------------	---	---------------------------------

◆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