

Central Daily Market Report

2021年1月21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21日 需給速報	2021年1月22日 需給予想	2021年1月25日 当社予想			
銀行券	400	400	1,000			
財政	2,600	7,300	▲7,000			
資金過不足	3,000	7,700	▲6,000			
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						
国債買入	13,200					
CP等買入		▲100	▲1,200			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			▲200			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入	200					
国債補充供給	▲300	100	300			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	16,100	6,600	▲6,000			
当座預金残高	4,868,100	4,874,700	4,868,700			
準備預金残高	4,285,000					
積み終了先	4,282,500			1月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,282,500			積数	5,000	
非準備預金先	583,100			1日平均	200	
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	99.86%	日数	19.35%		

●2021年1月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀・証券業態より▲0.050~▲0.005%の出合いで始まった。前日同様に強めの地合いとなり、一巡後は▲0.060~▲0.007%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(1/22-1/25)は、▲0.09~▲0.075%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、10Y345~361、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、6M物が▲0.105~▲0.103%、1Y物が▲0.123~▲0.121%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は化学・鉄鋼業態においてまとまった発行が実施された。償還総額850億円程度に対して、発行総額は1,500億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。

●2021年1月22日の予定

- *月例経済報告
- *12月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲1.1%)
- *米国12月の中古住宅販売
- *国庫短期証券(968回)入札(3ヶ月、67,000億円、1/25発行)
- *流動性供給入札(4,000億円、1/25発行)

●短期金融市場関連指標

2021/1/21	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	▲0.005	28,756.86	233.60	103.55-56	103.52-53
O/N	▲0.060	0.001	▲0.018				-	▲0.079						
T/N			▲0.001				-	▲0.080						
S/N							-	-						
1W	▲0.020	▲0.005	▲0.014				-	▲0.082						
2W			▲0.015				-	▲0.084						
3W							-	▲0.088						
1M							-	▲0.093						
3M							▲0.095	▲0.099						
6M							▲0.105	▲0.111						
1Y							▲0.123	▲0.141						
									日付	1/14	1/15	1/18	1/19	1/20
									日銀当預残	4,867,400	4,876,500	4,860,000	4,879,700	4,852,000
									準備預金残	4,321,400	4,281,600	4,272,300	4,270,400	4,273,400
									マネタリーベース	6,081,000	6,088,000	6,069,900	6,087,900	6,059,200
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.015%	▲0.024%	▲0.021%	▲0.019%
									コール市場残高	124,837	115,964	130,102	126,427	126,812
									うち無担	104,436	97,521	108,904	107,210	106,852
									うちO/N	62,023	61,138	72,201	69,282	66,634
									うち有担	20,401	18,443	21,198	19,217	19,960

●入札結果

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)	貸付レート ・利回総差 ・優待総差	金取レート ・利回総差 ・優待総差	平均貸付レート ・利回総差 ・優待総差	貸付 比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/21	2021/1/22	▲0.350	269	269		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/21	2021/1/22	▲0.350	0	0				

●日銀金融政策決定会合・結果

1. 現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。

(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成7反対1)

短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとする。

(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する。)

(2) 資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)

① ETFおよびJ-REITについて、当面は、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、積極的な買入れを行う。

(ETFおよびJ-REITの原則的な買入れ方針としては、引き続き、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加する

よう買入れを行い、その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうる

ものとする。)

② CP等、社債等については、それぞれ約2兆円、約3兆円の残高を維持する。これに加え、2021年9月末までの間、CP等、社債等の合計で約15兆円の

残高を上限に、追加の買入れを行う。

2. 「貸出増加を支援するための資金供給」および「成長基盤強化を支援するための資金供給」について、貸付実行期限を1年間延長することを決定。

(全員一致)

◆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