Central Daily Market Report

2021年1月22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22日 需給速報		2021年1月25日 需給予想		2021年1月26日 当社予想	
銀行券	400		500		1,000	
財政	6,500		▲ 14,400		0	
資金過不足	6,900		▲ 13,900		1,000	
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						
CP等買入		▲ 1,200		▲ 400		
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		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入			200			
国債補完供給		300				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	5,800		▲ 14,200		1,000	

当座預金残高	4,873,900	4,859,700	4,860,700
準備預金残高	4,261,900		
積み終了先	4,261,500		
超過準備	4,261,100		
非準備預金先	612,000		

1月25日以降の残り所要積立額	
積数	2,700
1日平均	100

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 99.93%	日数	29.03%

●2021年1月22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▲0.045～▲0.003%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強いなか、週末要因も重なりレートは上昇した。一巡後は▲0.060～▲0.005%での出合いがみられ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物の引き合いが散見された程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(1/25-1/26)は、▲0.085～▲0.070%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、5Y136～146、10Y345～361、20Y167～175、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（968回）の入札が実施された。WI取引において▲0.097～▲0.095%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.0922%、按分落札利回▲0.0882%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.087%出合いと、小甘く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。償還総額270億円程度に対して、発行総額は130億円程度と償還超となった。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

2021/1/22	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.016				－	▲ 0.086
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.080
S/N			▲ 0.001				－	－
1W	▲ 0.022	▲ 0.010	▲ 0.014				－	▲ 0.082
2W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.008				－	▲ 0.084
3W							－	▲ 0.088
1M							－	▲ 0.093
3M							▲ 0.087	▲ 0.099
6M							▲ 0.105	▲ 0.111
1Y							▲ 0.125	▲ 0.141

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.035	0.005	28,631.45	▲ 125.41	103.50-51	103.67-68

日付	1/15	1/18	1/19	1/20	1/21
日銀当預残	4,876,500	4,860,000	4,879,700	4,852,000	4,868,100
準備預金残	4,281,600	4,272,300	4,270,400	4,273,400	4,285,700
マネタリーベース	6,088,000	6,069,900	6,087,900	6,059,200	6,075,000
無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.024%	▲0.021%	▲0.019%	▲0.018%
コール市場残高	115,964	130,102	126,427	126,812	134,552
うち無担	97,521	108,904	107,210	106,852	113,587
うちO/N	61,138	72,201	69,282	66,634	71,139
うち有担	18,443	21,198	19,217	19,960	20,965

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	968	－	67,000	2021/1/25	2021/4/26	172,351.9	54,468.4	100.0220	▲0.0882%	8.7676%	100.0230	▲0.0922%	12,531.0
流動性供給	326	－	4,000	2021/1/25		19,053.0	3,985.0		0.0020%	80.7621%		▲0.0020%	

●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）		2021/1/22	2021/1/25	▲ 0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2021/1/22	2021/1/25	▲ 0.350	0	0				
社債等買入（残存期間3年超5年以下）	2000	2021/1/27			4,191	2,000	0.062		0.078	96.4

●2021年1月25日の予定

特にありません。

◆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。
◆本資料は何ら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論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