

Central Daily Market Report

2021年1月25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25日 需給速報	2021年1月26日 需給予想	2021年1月27日 当社予想
銀行券	400	500	0
財政	▲ 16,600	2,000	▲ 3,000
資金過不足	▲ 16,200	2,500	▲ 3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		14,100	
CP等買入		▲ 400	▲ 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		▲ 100	2,000
新型コロナウイルス対応金融支援特別			▲ 68,800
E T F 買入	200	100	
国債補完供給	▲ 200		200
*ドル資金供給用担保提供			
当増減	▲ 16,700	16,700	▲ 69,800
当座預金残高	4,857,200	4,873,900	4,804,100
準備預金残高	4,289,500		
積み終了先	4,289,100		1月26日以降の残り所要積立額
超過準備	4,289,100		積数 2,300
非準備預金先	567,700		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 99.94%	日数 32.26%	

●2021年1月25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▲0.05~▲0.005%の出合いで始まった。引き続き地銀を中心に調達ニーズは非常に強いものの、加重平均レートは週末要因が剥落したことで、前営業日から小幅低下した。一巡後は目立った出合いは無く、出し手の調整による散発的な出合いにとどまった。ターム物はオファーが少なく、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/26-1/27)は、▲0.085~▲0.070%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、5Y136~146、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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.089~▲0.087%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,400億円弱であったものの、陸運・食品・機械・不動産等複数の業態が大口の発行を実施したため、発行総額は3,600億円強に大きく膨らんだ。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/25	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	
	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)
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.078	0.035	0.000	28,822.29	190.84	103.78-79	103.70-71
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.070	▲ 0.008				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.008	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.084						
3W			0.050				-	▲ 0.089						
1M			0.030				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.089	▲ 0.099						
6M							▲ 0.105	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.141						
									日付	1/18	1/19	1/20	1/21	1/22
									日銀当預残	4,860,000	4,879,700	4,852,000	4,868,100	4,873,900
									準備預金残	4,272,300	4,270,400	4,273,400	4,285,700	4,263,100
									マネタリーベース	6,069,900	6,087,900	6,059,200	6,075,000	6,080,300
									無担O/N加重平均	▲0.024%	▲0.021%	▲0.019%	▲0.018%	▲0.016%
									コール市場残高	130,102	126,427	126,812	134,552	146,852
									うち無担	108,904	107,210	106,852	113,587	125,825
									うちO/N	72,201	69,282	66,634	71,139	73,687
									うち有担	21,198	19,217	19,960	20,965	21,027

●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	買付利率	応札総額(億円・百万ドル)	発札総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回敏感・価格敏感	全取レート・利回敏感・価格敏感	平均発付レート・利回敏感・価格敏感	抜付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2021/1/26			2,724	1,002	0.006		0.008	86.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/1/26			13,578	4,504	▲0.002		▲0.002	92.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2021/1/26			13,826	4,206	▲0.010		▲0.009	37.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/1/26			10,958	4,205	▲0.006		▲0.004	39.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/25	2021/1/26	▲ 0.350	208	208		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/25	2021/1/26	▲ 0.350	0	0				

●2021年1月26日の予定

*12月の企業向けサービス価格指数	*米国FOMC(1日目)	*40年利付国債入札(5,000億円、1/27発行)
	*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
	*米国1月のCB消費者信頼感指数	

◆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