

# Central Daily Market Report

2021年1月27日(水)  
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27日		2021年1月28日		2021年1月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 300			400
財政	▲ 2,700		1,500			▲ 1,100
資金過不足	▲ 3,100		1,200			▲ 700
<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			4,000	▲ 4,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	20,000					
国債買入			6,100			
CP等買入		▲ 800		▲ 100	6,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	2,000			▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別	118,200	▲ 68,800				
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 100	400		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	67,800		7,200			5,300
当座預金残高	4,941,900		4,949,100			4,954,400
準備預金残高	4,349,400					
積み終了先	4,349,100			1月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,349,100			積数	1,600	
非準備預金先	592,500			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	99.96%	日数	38.71%		

## ●2021年1月27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~▲0.004%の出合いであった。引き続き地銀を中心に調達ニーズが強くレートは前日比横ばい圏で推移した。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い中、ショートターム物で▲0.01%近辺の引き合いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(1/28-1/29)は、▲0.085~▲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、5Y136~146、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＞

本日のアウトライイト市場は、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.125%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、月末発行に当たり陸運、鉄鋼等の幅広い業態がまとまったロットでの発行を実施した。しかし、複数の大口償還がロールされなかったこともあり、1兆1,000億円強の償還総額に対して、発行は6,200億円弱にとどまり、大幅な償還超となった。発行レートに目立った変動は見られていない。

## ●短期金融市場関連指標

2021/1/27	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	
	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.081	0.035	0.005	28,635.21	89.03	103.59-61	103.67-69
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.020	0.002				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.018	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.088						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.090	▲ 0.098						
6M							▲ 0.105	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.141						
									日付	1/20	1/21	1/22	1/25	1/26
									日銀当預残	4,852,000	4,868,100	4,873,900	4,857,200	4,874,100
									準備預金残	4,273,400	4,285,700	4,263,100	4,289,500	4,298,200
									マネタリーベース	6,059,200	6,075,000	6,080,300	6,063,200	6,079,700
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.018%	▲0.016%	▲0.017%	▲0.016%
									コール市場残高	126,812	134,552	146,852	143,033	128,862
									うち無担	106,852	113,587	125,825	121,892	107,646
									うちO/N	66,634	71,139	73,687	69,554	63,258
									うち有担	19,960	20,965	21,027	21,141	21,216

## ●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	業分率	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	貸付利率	応募総額(億円・百万ドル)	着札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均着札レート・利回差・価格差	競争比率
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2021/1/28	2021/2/12		3,951	3,951				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/1/28			14,351	4,506	0.005		0.006	73.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2021/1/28			5,818	1,208	0.012		0.012	44.5
国債買入(物価連動債)	300	2021/1/28			1,809	301	▲0.160		▲0.274	94.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/27	2021/1/28	▲ 0.350	103	103		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/27	2021/1/28	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2021年1月28日の予定

*12月の商業動態統計速報	*米国10-12月期のGDP速報値 *米国12月の新築一戸建て販売件数	*2年利付国債入札(30,000億円、2/1発行) *交付税特別会計借入(10,000億円、2/5借入)
---------------	--	---

◆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