

Central Daily Market Report

2021年1月29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29日		2021年2月1日		2021年2月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		600		1,000	
財政	8,000		▲ 23,400		▲ 8,000	
資金過不足	8,000		▲ 22,800		▲ 7,000	
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			8,900			
CP等買入	6,000	▲ 3,000		▲ 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	400					
国債補充供給	▲ 100			100		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	11,200		▲ 13,900		▲ 7,000	
当座預金残高	4,959,000		4,945,100		4,938,100	
準備預金残高	4,354,800					
積み終了先	4,354,800		2月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,354,500		積数		300	
非準備預金先	604,200		1日平均		0	
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	99.99%	日数	51.61%		

●2021年1月29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▲0.03~▲0.003%の出合いで始まった。月末のため調達を控える先も見られたが、3日積みとなるため、大手行を中心に調達ニーズが強くなったこともあり、レートは前日比で上昇した。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、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(2/1-2/2)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>

本日はTB3M物(969回)の入札が実施された。WI取引において▲0.090%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0919%、按分落札利回▲0.0875%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、▲0.110~▲0.105%出合いと、やや強含みで推移した。この他に、1Y物が▲0.125%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額が150億円と少額であったこともあり、食料品業態から300億円弱の発行が見られたのみであった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/29	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.086	0.050	0.015	27,663.39	▲ 534.03	104.30-31	104.54-56
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.005	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.085						
3W			▲ 0.008				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.020	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.104	▲ 0.100						
6M							▲ 0.115	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.127	▲ 0.140						
									日付	1/22	1/25	1/26	1/27	1/28
									日銀当預残	4,873,900	4,857,200	4,874,100	4,941,900	4,947,800
									準備預金残	4,263,100	4,289,500	4,298,200	4,349,400	4,353,400
									マネタリーベース	6,080,300	6,063,200	6,079,700	6,147,900	6,154,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.017%	▲ 0.016%
									コール市場残高	146,852	143,033	128,862	135,232	129,670
									うち無担	125,825	121,892	107,646	113,824	108,897
									うちO/N	73,687	69,554	63,258	69,361	64,684
									うち有担	21,027	21,141	21,216	21,408	20,773

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	969	-	67,000	2021/2/1	2021/5/10	206,118.3	54,434.3	100.0235	▲0.0875%	21.2250%	100.0247	▲0.0919%	12,565.0

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2021/2/1			11,100	4,203	0.002		0.004	67.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/2/1			12,261	4,212	0.012		0.013	50.9
国債買入(残存期間25年超)	300	2021/2/1			1,885	308	0.013		0.014	7.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/29	2021/2/1	▲ 0.350	69	69		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/29	2021/2/1	▲ 0.350	47	47		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年2月1日の予定

- *米国12月の建設支出
- *米国1月のISM製造業景況指数

◆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