

# Central Daily Market Report

2021年1月20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20日		2021年1月21日		2021年1月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		400		0	
財政	▲ 28,200		2,100		1,000	
資金過不足	▲ 27,300		2,500		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			13,200			
CP等買入		▲ 900		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	200		200			
国債補完供給	▲ 100	400		100		
米ドル資金供給用担保提供						
当預増減	▲ 27,700		15,900		1,000	
当座預金残高	4,852,000		4,867,900		4,868,900	
準備預金残高	4,272,500					
積み終了先	4,269,800		1月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,269,700		積数	7,600		
非準備預金先	579,500		1日平均	300		
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	99.79%	日数	16.13%		

## ●2021年1月20日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢より▲0.055~▲0.005%の出会いで始まった。引き続き地銀業態を中心に調達意欲は強く、レートは小幅上昇した。一巡後は▲0.060~▲0.010%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、1W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(1/21-1/22)は、▲0.085~▲0.075%程度での出会い。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、5Y136~145、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>

本日はTB6M物(967回)の入札が実施された。WI取引において▲0.093%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.0982%、按分落札利回▲0.0962%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.105~▲0.1015%出会いと堅調に推移した。この他に3M物が▲0.097~▲0.090%、1Y物が▲0.122%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は不動産業態において大型発行が実施された。償還総額850億円程度に対して、発行総額は700億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

2021/1/20	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.079	0.035	▲ 0.005	28,523.26	▲ 110.20	103.90-91	103.74-75
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.081						
S/N	▲ 0.001	0.001	▲ 0.001				-	-						
1W	▲ 0.018	0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.011	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.095	▲ 0.099						
6M							▲ 0.105	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.122	▲ 0.141						
									日付	1/13	1/14	1/15	1/18	1/19
									日銀当預残	4,878,100	4,867,400	4,876,500	4,860,000	4,879,700
									準備預金残	4,334,200	4,321,400	4,281,600	4,272,300	4,270,400
									マネタリーベース	6,093,300	6,081,000	6,088,000	6,069,900	6,087,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.008%	▲ 0.015%	▲ 0.024%	▲ 0.021%
									コール市場残高	127,274	124,837	115,964	130,102	126,427
									うち無担	107,082	104,436	97,521	108,904	107,210
									うちO/N	66,169	62,023	61,138	72,201	69,282
									うち有担	20,192	20,401	18,443	21,198	19,217

## ●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	967	-	38,000	2021/1/25	2021/7/26	124,578.2	30,899.7	100.0480	▲0.0962%	76.2882%	100.0490	▲0.0982%	7,100.0
交付税特会	-	-	10,000	2021/1/29	2021/7/30	373,984.0	10,000.28		0.0000%	2.6740%		0.0000%	

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/1/21			8,963	4,503	▲0.007		▲0.005	33.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2021/1/21			16,650	4,205	▲0.008		▲0.007	7.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2021/1/21			10,576	4,208	▲0.005		▲0.004	67.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/20	2021/1/21	▲ 0.350	116	116		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/20	2021/1/21	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/1/22	2021/1/28	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2021/1/22	2021/4/15	0.330	0	0				

## ●2021年1月21日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*ECB定例理事会(金融政策発表)
*黒田日銀総裁定例会見	*米国12月の住宅着工件数
*経済・物価情勢の展望	
*12月の貿易統計	

◆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