

Central Daily Market Report

2021年1月28日(木)
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28日		2021年1月29日		2021年2月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300	0				1,000
財政	200		7,900			▲ 19,000
資金過不足	▲ 100		7,900			▲ 18,000
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	4,000	▲ 4,100				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,100					
CP等買入		▲ 100	6,000	▲ 3,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入		▲ 100		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	100		400			
国債補完供給		100				
当増減	5,900		11,200			▲ 18,000
当座預金残高	4,947,800		4,959,000			4,941,000
準備預金残高	4,351,200					
積み終了先	4,350,900				1月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,350,900				積数	1,300
非準備預金先	596,600				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	41.94%		

●2021年1月28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~▲0.004%の出合いで始まった。引き続き地銀を中心に調達ニーズが強い中、レート水準に大きな変化はなく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、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(1/29-2/1)は、▲0.105~▲0.080%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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.105%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、応当が月初にあたり償還は見られなかったものの、石油・鉄鋼・ノンバンク等から発行が実施され、発行総額は1,200億円弱となった。発行レートは概ね横ばい圏での決着が中心となった。

●短期金融市場関連指標

2021/1/28	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.016				-	▲ 0.082	0.035	0.000	28,197.42	▲ 437.79	104.14-15	104.30-32
T/N	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.010	▲ 0.009				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.010	0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.015	▲ 0.013	▲ 0.014				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.090	▲ 0.099						
6M							▲ 0.105	▲ 0.109						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.141						
									日付	1/21	1/22	1/25	1/26	1/27
									日銀当預残	4,868,100	4,873,900	4,857,200	4,874,100	4,941,900
									準備預金残	4,285,700	4,263,100	4,289,500	4,298,200	4,349,400
									マネタリーベース	6,075,000	6,080,300	6,063,200	6,079,700	6,147,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.016%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.017%
									コール市場残高	134,552	146,852	143,033	128,862	135,232
									うち無担	113,587	125,825	121,892	107,646	113,824
									うちO/N	71,139	73,687	69,554	63,258	69,361
									うち有担	20,965	21,027	21,141	21,216	21,408

●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)
2年利付国債	421	0.10%	30,000	2021/2/1	2023/2/1	121,124.0	24,362.0	100.4500	▲0.1240%	13.9251%	100.4560	▲0.1270%	5,627.0
交付税特会	-	-	10,000	2021/2/5	2021/8/6	356,751.0	10,000.33		0.0000%	2.8032%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/28	2021/1/29	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/28	2021/1/29	▲ 0.350	0	0				

●2021年1月29日の予定

*決定会合における主な意見(1月20、21日分)	*米国12月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(969回)入札(3ヶ月、67,000億円、2/1発行)
*12月の完全失業率(市場予想：3.0%)	*米国1月のシカゴPM景況感指数	
*12月の有効求人倍率(市場予想：1.06倍)		
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲1.5%)		
*1月の都区部消費者物価指数(市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.6%)		
*12月の住宅着工統計		

◆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