

# Central Daily Market Report

2021年1月13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13日		2021年1月14日		2021年1月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,900		1,500		2,000	
財政	▲1,000		▲27,700		3,000	
資金過不足	1,900		▲26,200		5,000	
<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
<b>貸出</b>						
全店共通	4,100	▲4,700				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			15,000			
国債買入	11,500					
CP等買入				▲300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						200
社債等買入	3,000					
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	100		500			
国債補完供給	▲300	400		300		
<small>※ドル資金供給用担保確保供給</small>						
当増減	16,000		▲10,700		5,200	
当座預金残高	4,878,100		4,867,400		4,872,600	
準備預金残高	4,332,600					
積み終了先	4,332,600		1月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,332,600		積数		0	
非準備預金先	545,500		1日平均		0	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,592,300	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	93.55%		

## ●2021年1月13日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態から積極的な資金調達ニーズが見られたため、昨日より高い水準での取引となった。立ち上がりは、都銀・地銀・証券業態などから▲0.025~▲0.005%の水準での調達が見られた。一巡後はさらに取り上げる先も見られ、▲0.05~▲0.003%のレンジの出会いで推移した。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(1/14-1/15)は、▲0.08~▲0.07%程度での出会い。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、5Y136~145、10Y345~360、20Y167~174、30Y59~68、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、短国買入オペ15,000億円がオファーされた。平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差+0.000%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.090~▲0.088%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、電気機器・建設・電力業態で大型発行があり、償還総額は3,100億円程度に対し発行総額は4,000億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/1/13	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲0.012				-	▲0.079	0.025	▲0.005	28,456.59	292.25	103.74-75	103.68-69
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.006				-	▲0.077						
S/N							-	-						
1W	▲0.013	▲0.010	▲0.012				-	▲0.080						
2W							-	▲0.083						
3W							-	▲0.088						
1M			0.013				-	▲0.091						
3M							▲0.091	▲0.100						
6M							▲0.105	▲0.114						
1Y							▲0.120	▲0.143						
									日付	1/5	1/6	1/7	1/8	1/12
									日銀当預残	4,934,500	4,896,800	4,890,500	4,895,000	4,862,100
									準備預金残	4,326,300	4,315,100	4,313,400	4,301,100	4,318,800
									マネタリーベース	6,161,500	6,121,600	6,113,200	6,115,400	6,080,100
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.018%	▲0.018%	▲0.016%	▲0.016%
									コール市場残高	118,410	120,327	117,958	125,806	111,578
									うち無担	97,122	98,967	98,186	105,110	91,294
									うちO/N	62,669	62,814	60,703	67,977	54,441
									うち有担	21,288	21,360	19,772	20,696	20,284

## ●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)
5年利付国債	146	0.10%	25,000	2021/1/14	2025/12/20	77,735.0	20,302.0	101.0200	▲0.1050%	39.5061%	101.0500	▲0.1110%	4,690.0
交付税特会	-	-	10,000	2021/1/22	2021/7/26	319,232.0	10,000.20		0.0000%	3.1326%		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
国庫短期証券買入	15,000	2021/1/14			35,214	15,006	0.000		0.002	38.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/1/13	2021/1/14	▲0.350	261	261		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/1/13	2021/1/14	▲0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第7回	2021/1/15	2022/11/18	0	203

## ●2021年1月14日の予定

- \*11月の機械受注統計(市場予想:電力除く民需、前月比▲6.2%)
- \*12月の企業物価指数

◆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