

Central Daily Market Report

2020年12月2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	2020年12月2日		2020年12月3日		2020年12月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 2,000		▲ 2,000	
財政	▲ 96,600		10,400		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 97,800		8,400		▲ 8,000	
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	1,900	▲ 1,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	30,000					
国債買入			10,800			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)	1,700	▲ 6,700				
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						
国債補完供給		300				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増増減	▲ 72,200		18,800		▲ 8,000	
当座預金残高	4,766,300		4,785,100		4,777,100	
準備預金残高	4,197,600					
積み終了先	4,197,600		12月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,197,600		積数	200		
非準備預金先	568,700		1日平均	0		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,451,500	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	56.67%		

●2020年12月2日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、税揚げ日に当たるものの参加者の姿勢に大きな変化は無く、前日とほぼ同水準での取引となった。立ち上がりは都銀業態から▲0.05%~▲0.045%、地銀・証券業態などから▲0.035~▲0.015%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.075~▲0.02%で出合いが見られ本日の取引を終えた。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＞

GCT/N(12/3-12/4)は、▲0.080~▲0.070%程度での出合い。SCI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2Y410~419、5Y136~145、10Y345~360、20Y167~173、30Y59~68、40Y10~13等にビッドの出入りがあった。

＜短国市場＞

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.090%、1Y物が▲0.131~▲0.130%で出合った。

＜CP市場＞

発行市場は償還総額300億円程度に対して、発行総額は700億円程度と発行超であった。一部の石油業態において大型発行が見られたものの、案件は少なく比較的閑散としたマーケットであった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。CP等買入オペアが6,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.031%、按分レート▲0.039%と、前回比で平均、按分ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2020/12/2	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	
	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)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	0.020	0.005	26,800.98	13.44	104.29-30	104.56-57
O/N	▲ 0.075	0.010	▲ 0.029				-	▲ 0.077						
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.028	▲ 0.018	▲ 0.022				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.085						
3W	▲ 0.045	0.030	0.007				-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.090	▲ 0.107						
6M							▲ 0.098	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.155						
日付		11/25	11/26	11/27	11/30	12/1								
日銀当預残	4,836,000	4,828,600	4,868,100	4,868,000	4,838,500									
準備預金残	4,232,400	4,256,900	4,276,100	4,287,900	4,265,100									
マネタリーベース	6,024,300	6,018,300	6,058,800	6,059,200	6,030,200									
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.030%	▲0.030%	▲0.032%	▲0.030%									
コール市場残高	124,414	128,556	140,869	119,713	120,051									
うち無担	102,138	106,857	120,085	100,290	99,557									
うちO/N	61,220	65,459	79,647	60,852	60,849									
うち有担	22,276	21,699	20,784	19,423	20,494									

●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	案分率	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年以下)	1,500	2020/12/3			3,032	1,505	0.002		0.006	9.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2020/12/3			12,760	5,009	0.002		0.003	85.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2020/12/3			11,869	4,204	0.003		0.005	23.9
CP等買入	6,000	2020/12/7			10,834	5,994	▲0.039		▲0.031	30.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/2	2020/12/3	▲0.350	47	47		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/2	2020/12/3	▲0.350	0	0				

●2020年12月3日の予定

*12月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国11月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札(9,000億円、12/4発行)
		*交付税特別会計借入(11,000億円、12/11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