

Central Daily Market Report

2020年12月3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	2020年12月3日		2020年12月4日		2020年12月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	9,100		▲ 8,400		▲ 5,000	
資金過不足	7,100		▲ 9,600		▲ 6,000	
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	10,800					
CP等買入		▲ 300		▲ 100	6,000	
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				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400			400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	17,100		▲ 9,300		0	
当座預金残高	4,783,400		4,774,100		4,774,100	
準備預金残高	4,200,900					
積み終了先	4,200,800		12月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,200,800		積数		200	
非準備預金先	582,500		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	60.00%		

●2020年12月3日の市場動向

◀インターバンク市場▶

本日の無担O/N物は、参加者の動向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▲0.05~▲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▶

GC T/N(12/4-12/7)は、▲0.085~▲0.070%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2Y410~419、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%で出合った。

◀CP市場▶

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は発行・償還額共に150億円程度であった。小型案件のみの閑散としたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/12/3	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.076	0.020	0.000	26,809.37	8.39	104.44-45	104.31-32
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.018	▲ 0.019				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.090	▲ 0.106						
6M							▲ 0.098	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.155						
									日付	11/26	11/27	11/30	12/1	12/2
									日銀当預残	4,828,600	4,868,100	4,868,000	4,838,500	4,766,300
									準備預金残	4,256,900	4,276,100	4,287,900	4,265,100	4,197,600
									マネタリーベース	6,018,300	6,058,800	6,059,200	6,030,200	5,959,200
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.030%	▲0.032%	▲0.030%	▲0.029%
									コール市場残高	128,556	140,869	119,713	120,051	123,579
									うち無担	106,857	120,085	100,290	99,557	102,258
									うちO/N	65,459	79,647	60,852	60,849	63,935
									うち有担	21,699	20,784	19,423	20,494	21,321

●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)
30年利付国債	68	0.60%	9,000	2020/12/4	2050/9/20	25,311.0	7,259.0	98.7500	0.6500%	82.6720%	98.8000	0.6480%	1,734.0
交付税特会	-	-	11,000	2020/12/11	2021/6/11	392,180.0	11,000.58		0.0000%	2.8050%		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)		2020/12/3	2020/12/4	▲ 0.350	345	345		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/3	2020/12/4	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月4日の予定

*米国10月の貿易収支
*米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国11月の雇用統計

*国庫短期証券(956回)入札
(3ヶ月、75,500億円、12/7発行)

◆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