Central Daily Market Report

2020年12月4日（金）
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4日 需給速報		2020年12月7日 需給予想		2020年12月8日 当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 500		▲ 2,000	
財政	▲ 8,300		▲ 4,600		16,000	
資金過不足	▲ 9,500		▲ 5,100		14,000	
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			5,600			
CP等買入		▲ 100	6,000	▲ 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				▲ 400		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	400		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 9,500		6,300		14,000	

当座預金残高	4,773,900	4,780,200	4,794,200
準備預金残高	4,186,700		
積み終了先	4,186,700		
超過準備	4,186,700		
非準備預金先	587,200		

12月7日以降の残り所要積立額	
積数	100
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	100.00%	日数 70.00%

●2020年12月4日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により取り上がる先が一部で見られたため、前日より若干高めの水準での取引となった。立ち上がりは都銀業態から▲0.04%、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、1W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(12/7-12/8)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>

本日はTB3M物（956回）の入札が実施された。WI取引において▲0.090～▲0.087%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0889%、按分落札利回▲0.0837%と、やや軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは出合いは見られなかったものの、入札と同水準で推移した。この他に、1Y物が▲0.139～▲0.135%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。発行市場は償還総額200億円程度に対して、発行総額は250億円程度と若干の発行超であった。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

2020/12/4	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.030				－	▲ 0.077
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.008				－	▲ 0.077
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.019				－	▲ 0.081
2W							－	▲ 0.084
3W							－	▲ 0.089
1M							－	▲ 0.100
3M							▲ 0.083	▲ 0.107
6M							▲ 0.097	▲ 0.131
1Y							▲ 0.138	▲ 0.154

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.020	0.000	26,751.24	▲ 58.13	103.83-84	103.89-90

日付	11/27	11/30	12/1	12/2	12/3
日銀当預残	4,868,100	4,868,000	4,838,500	4,766,300	4,783,400
準備預金残	4,276,100	4,287,900	4,265,100	4,197,600	4,201,500
マネタリーベース	6,058,800	6,059,200	6,030,200	5,959,200	5,978,300
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.032%	▲0.030%	▲0.029%	▲0.030%
コール市場残高	140,869	119,713	120,051	123,579	132,036
うち無担	120,085	100,290	99,557	102,258	111,523
うちO/N	79,647	60,852	60,849	63,935	70,650
うち有担	20,784	19,423	20,494	21,321	20,513

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	956	－	75,500	2020/12/7	2021/3/15	163,410.5	61,334.5	100.0225	▲0.0837%	18.4088%	100.0239	▲0.0889%	14,165.0

●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5年超10年以下）	4,200	2020/12/7			10,568	4,206	▲0.005		▲0.004	29.7
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,200	2020/12/7			3,318	1,207	0.001		0.002	30.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/12/4	2020/12/7	▲ 0.350	290	290		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/12/4	2020/12/7	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月7日の予定

*10月の景気動向指数速報
*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国10月の消費者信用残高

◆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。
◆本資料は何ら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論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