

# Central Daily Market Report

2020年12月8日(火)

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8日		2020年12月9日		2020年12月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 1,000		▲ 3,000	
財政	16,300		▲ 22,400		▲ 29,000	
資金過不足	15,100		▲ 23,400		▲ 32,000	

	スタート		エンド		スタート		エンド	
金融調節								
貸出								
全店共通								
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入				25,000				
国債買入	5,900							
CP等買入		▲ 300		▲ 600				
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		3,000		
新型コロナ対応金融支援特別								
E T F 買入	100			600				
国債補完供給	▲ 100	300		100				
※ドル資金供給用担保提供額								
当預増減	21,000		1,600		▲ 29,000			

当座預金残高	4,802,400	4,804,000	4,775,000
準備預金残高	4,202,900		
積み終了先	4,202,900		12月9日以降の残り所要積立額
超過準備	4,202,900		積数 100
非準備預金先	599,500		1日平均 0
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			3,459,500
準備預金進捗率	実績 100.00%	日数	76.67%

## ●2020年12月8日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に、前営業日から横ばいの▲0.05~▲0.018%の出会い。一巡後は▲0.075~▲0.018%の出会いが見られ、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見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(12/9-12/10)は、▲0.090~▲0.085%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2Y410~419、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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペが前回から5,000億円減額の25,000億円でオフアされた。平均落札利回り較差+0.003%、按分落札利回り較差▲0.002%と、しっかりした結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.143%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は電気機器、不動産、その他金融業態において大型発行が実施された。償還総額1,300億円程度に対して、発行総額は3,000億円程度と発行超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/12/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買差額統計値	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.084	0.015	▲ 0.005	26,467.08	▲ 80.36	104.00-02	104.07-09
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.088						
3W			0.001				-	▲ 0.090						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.085	▲ 0.106						
6M							▲ 0.097	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.154						

日付	12/1	12/2	12/3	12/4	12/7
日銀当預残	4,838,500	4,766,300	4,783,400	4,773,900	4,781,400
準備預金残	4,265,100	4,197,600	4,201,500	4,186,700	4,192,600
マネタリーベース	6,030,200	5,959,200	5,978,300	5,970,000	5,978,200
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.029%	▲0.030%	▲0.030%	▲0.028%
コール市場残高	120,051	123,579	132,036	147,259	121,340
うち無担	99,557	102,258	111,523	126,756	101,734
うちO/N	60,849	63,935	70,650	85,863	60,491
うち有担	20,494	21,321	20,513	20,503	19,606

## ●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	145	0.10%	25,000	2020/12/9	2025/9/20	80,556.0	20,353.00	101.0300	▲0.1140%	91.2414%	101.0500	▲0.1180%	4,640.0

## ●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
国庫短期証券買入	25,000	2020/12/9			44,417	25,003	▲0.002		0.003	59.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2020/12/8	2020/12/9	▲ 0.350	99	99		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2020/12/8	2020/12/9	▲ 0.350	9	9		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/12/10	2020/12/17	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2020/12/10	2021/3/4	0.330	0	0				

## ●2020年12月9日の予定

- \*10月の機械受注統計(市場予想:電力除く民需、前月比+2.8%)
- \*10月の特定サービス産業動態統計速報
- \*11月のマネーストック
- \*米国10月の卸売売上高
- \*国庫短期証券(957回)入札(6ヶ月、38,000億円、12/10発行)
- \*交付税特別会計借入(11,000億円、12/18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り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