

Central Daily Market Report

2020年12月9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9日		2020年12月10日		2020年12月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 2,300		▲ 3,000	
財政	▲ 25,600		▲ 31,000		3,000	
資金過不足	▲ 26,600		▲ 33,300		0	

●2020年12月9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▲0.05～▲0.015%の出合い。一部の先では調達レートを切り下げる動きも見られた。一巡後は▲0.075～▲0.02%の出合いが見られ、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(12/10-12/11)は、▲0.085～▲0.080%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、20Y167～174、30Y59～68、40Y10～13等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB6M物(957回)の入札が実施された。WI取引において▲0.086%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0882%、按分落札利回▲0.0861%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.097～▲0.090%出合いと、堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.090～▲0.085%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は機械、建設業態において大型発行が実施された。償還総額2,500億円程度に対して、発行総額は1,400億円程度と償還超となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

金融調節	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	25,000							
国債買入								
CP等買入		▲ 600		▲ 300				
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	600							
国債補完供給	▲ 100	100		100				
※ドル資金供給用担保提供供給								
当預増減	▲ 1,700		▲ 30,500					0

当座預金残高	4,800,700	4,770,200	4,770,200
準備預金残高	4,191,700		
積み終了先	4,191,600		12月10日以降の残り所要積立額
超過準備	4,191,600		積数
非準備預金先	609,000		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
			80.00%

●短期金融市場関連指標

2020/12/9	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	▲ 0.032				-	▲ 0.084	0.015	0.000	26,817.94	350.86	104.13-14	104.22-23
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.086						
2W			0.010				-	▲ 0.087						
3W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.090	▲ 0.107						
6M							▲ 0.091	▲ 0.128						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.152						
									日付	12/2	12/3	12/4	12/7	12/8
									日銀当預残	4,766,300	4,783,400	4,773,900	4,781,400	4,802,400
									準備預金残	4,197,600	4,201,500	4,186,700	4,192,600	4,203,200
									マネタリーベース	5,959,200	5,978,300	5,970,000	5,978,200	6,000,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.030%	▲ 0.030%	▲ 0.028%	▲ 0.028%
									コール市場残高	123,579	132,036	147,259	121,340	123,446
									うち無担	102,258	111,523	126,756	101,734	102,456
									うちO/N	63,935	70,650	85,863	60,491	62,263
									うち有担	21,321	20,513	20,503	19,606	20,990

●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)
国庫短期証券	957	-	38,000	2020/12/10	2021/6/10	112,359.0	31,086.8	100.0430	▲0.0861%	54.2005%	100.0440	▲0.0882%	6,913.0
交付税特会	-	-	11,000	2020/12/18	2021/6/18	398,360.0	11,000.10		0.0000%	2.7614%		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)		2020/12/9	2020/12/10	▲ 0.350	106	106		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/9	2020/12/10	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月10日の予定

*11月の企業物価指数	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*20年利付国債入札(12,000億円、12/11発行)
*10-12月期の法人企業景気予測調査季報	*米国11月の消費者物価指数	
	*米国11月の財政収支	

◆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