Central Daily Market Report

2020年12月10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10日 需給速報		2020年12月11日 需給予想		2020年12月14日 当社予想	
銀行券	▲ 2,300		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	▲ 29,500		▲ 600		▲ 17,000	
資金過不足	▲ 31,800		▲ 2,000		▲ 18,000	
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 900		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入	3,000			▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 29,300		▲ 2,600		▲ 18,000	

当座預金残高	4,771,400	4,768,800	4,750,800
準備預金残高	4,162,900		
積み終了先	4,162,900		
超過準備	4,162,900		
非準備預金先	608,500		

12月11日以降の残り所要積立額	
積数	0
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	83.33%

●2020年12月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前営業日とほぼ同水準での取引となった。立ち上がりは国内勢の調達を中心に▲0.05～▲0.015%の出合い。一巡後は▲0.07～▲0.02%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、月内物の引き合いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/11-12/14)は、▲0.090～▲0.085%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▲0.091～▲0.090%、6M物が▲0.090%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は石油・石炭業態においてまとまった発行が実施された。償還総額330億円程度に対して、発行総額は530億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

2020/12/10	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	▲ 0.032				－	▲ 0.082
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.030				－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.020				－	▲ 0.086
2W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.021				－	▲ 0.086
3W							－	▲ 0.095
1M			▲ 0.040				－	▲ 0.102
3M							▲ 0.090	▲ 0.107
6M							▲ 0.091	▲ 0.127
1Y							▲ 0.138	▲ 0.152

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）
0.010	▲ 0.005	26,756.24	▲ 61.70	104.28-29	104.48-49

日付	12/3	12/4	12/7	12/8	12/9
日銀当預残	4,783,400	4,773,900	4,781,400	4,802,400	4,800,700
準備預金残	4,201,500	4,186,700	4,192,600	4,203,200	4,191,800
マネタリーベース	5,978,300	5,970,000	5,978,200	6,000,400	5,999,700
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.030%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.032%
コール市場残高	132,036	147,259	121,340	123,446	145,084
うち無担	111,523	126,756	101,734	102,456	124,594
うちO/N	70,650	85,863	60,491	62,263	82,796
うち有担	20,513	20,503	19,606	20,990	20,490

●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)
20年利付国債	174	0.40%	12,000	2020/12/11	2040/9/20	29,364.0	9,751.0	100.5000	**0.3720%**	**14.6471%**	100.6200	**0.3660%**	2,245.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/12/10	2020/12/11	▲ 0.350	217	217		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/12/10	2020/12/11	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月11日の予定

*米国11月の生産者物価指数
*米国12月のミシガン大消費者信頼感指数速報

*国庫短期証券(958回)入札
（3ヶ月、73,000億円、12/14発行）

*エネルギー対策借入
（6,000億円、12/21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