Central Daily Market Report

2020年12月11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11日 需給速報		2020年12月14日 需給予想		2020年12月15日 当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 1,200		▲ 2,000	
財政	▲ 1,100		▲ 13,200		75,000	
資金過不足	▲ 2,600		▲ 14,400		73,000	
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			13,900			
CP等買入		▲ 900		▲ 700		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）					54,700	▲ 54,000
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入	100					
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 3,400		▲ 1,000		73,700	

当座預金残高	4,768,000	4,767,000	4,840,700
準備預金残高	4,180,500		
積み終了先	4,180,500		
超過準備	4,180,500		
非準備預金先	587,500		

12月14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	93.33%

●2020年12月11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▲0.045～▲0.015%の出合い。積み最終日を2営業日後に控えていることや週末要因により、一部の業態では取り上がる動きも見られた。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、月内物のロール案件が散見された程度であった。

<レポ市場>

GC T/N(12/14-12/15)は、▲0.08～▲0.06%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（958回）の入札が実施された。WI取引において▲0.088～▲0.085%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0867%、按分落札利回▲0.0837%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、▲0.088～▲0.085%出合いと、やや堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.092～▲0.091%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は電気機器・建設業態において大型発行が実施された。償還総額2,400億円程度に対して、発行総額は4,000億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

2020/12/11	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				－	▲ 0.081
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.003				－	▲ 0.077
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	▲ 0.018	▲ 0.019				－	▲ 0.082
2W			▲ 0.003				－	▲ 0.085
3W							－	▲ 0.096
1M							－	▲ 0.100
3M							▲ 0.086	▲ 0.104
6M							▲ 0.092	▲ 0.127
1Y							▲ 0.149	▲ 0.150

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	0.000	26,652.52	▲ 103.72	104.17-18	104.06-07

日付	12/4	12/7	12/8	12/9	12/10
日銀当預残	4,773,900	4,781,400	4,802,400	4,800,700	4,771,400
準備預金残	4,186,700	4,192,600	4,203,200	4,191,800	4,163,300
マネタリーベース	5,970,000	5,978,200	6,000,400	5,999,700	5,972,800
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.032%	▲0.032%
コール市場残高	147,259	121,340	123,446	145,084	141,065
うち無担	126,756	101,734	102,456	124,594	120,310
うちO/N	85,863	60,491	62,263	82,796	77,592
うち有担	20,503	19,606	20,990	20,490	20,755

●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	958	－	73,000	2020/12/14	2021/3/22	182,061.0	59,361.4	100.0225	▲0.0837%	93.2562%	100.0233	▲0.0867%	13,638.0
エネルギー対策	－	－	6,000	2020/12/21	2021/12/20	155,437.0	5,999.87		0.0000%	3.8601%		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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	5,000	2020/12/14			11,669	5,003	▲0.001		0.001	63.5
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2020/12/14			7,027	4,201	▲0.009		▲0.004	54.8
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,200	2020/12/14			8,546	4,207	▲0.003		▲0.002	79.5
国債買入（物価連動債）	300	2020/12/14			1,681	300		▲0.070	▲0.178	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/12/11	2020/12/14	▲ 0.350	212	212		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/12/11	2020/12/14	▲ 0.350	0	0				

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
貸出増加支援オペ	貸付期間4年（新規貸付）	2020/12/15	2024/12/13	0	54,701

●2020年12月14日の予定

*10月の第3次産業活動指数
*12月調査の日銀短観（概要及び要旨）（ 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数（DI）：▲15）

◆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