

Central Daily Market Report

2020年12月14日(月)

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14日		2020年12月15日		2020年12月16日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 1,800	▲ 1,800	▲ 1,800	▲ 3,000	▲ 3,000
財政	▲ 16,600	75,300	75,300	75,300	▲ 37,000	▲ 37,000
資金過不足	▲ 17,800	73,500	73,500	73,500	▲ 40,000	▲ 40,000
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						▲ 1,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			25,000			
国債買入	13,900					
CP等買入		▲ 700		▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			54,700	▲ 49,000		
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 1,300	200		1,300		
*ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 5,700		104,300		▲ 41,900	
当座預金残高	4,762,300		4,866,600		4,824,700	
準備預金残高	4,215,600					
積み終了先	4,215,600				12月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,215,600				積数	0
非準備預金先	546,700				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	96.67%		

●2020年12月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.04~▲0.018%の出合いで始まった。着地に向けた調整から地銀の調達ニーズがやや後退した一方で、大手行が調達を強めたため、全体で見るとレートが上昇した。一巡後はビッド水準に大きな変化は見られなかったものの、一部で▲0.07~▲0.04%の出合いが散見された。ターム物は年内物で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(12/15-12/16)は、▲0.085~▲0.075%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2Y410~418、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、短国買入オペアが前回と同額の25,000億円でオファーされた。応札対象銘柄が減少したこともあって、平均落札利回差▲0.003%、按分落札利回差▲0.010%と、やや強めの結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.089%、6M物が▲0.104~▲0.092%、1Y物が▲0.130~▲0.120%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は閑散で、償還総額は200億円程度に対し発行総額は400億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入オペアが、事前予定通りの6,000億円でオファーされた。平均落札レート▲0.011%、按分レート▲0.039%と、前回比(平均▲0.031%・按分▲0.039%)で平均は上昇、按分は横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/14	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.070	0.010	0.000	26,732.44	79.92	103.97-98	103.91-92
T/N	▲ 0.050	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.030	▲ 0.010				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.021				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.096	▲ 0.106						
6M							▲ 0.102	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.151						
									日付	12/7	12/8	12/9	12/10	12/11
									日銀当預残	4,781,400	4,802,400	4,800,700	4,771,400	4,768,000
									準備預金残	4,192,600	4,203,200	4,191,800	4,163,300	4,180,500
									マネタリーベース	5,978,200	6,000,400	5,999,700	5,972,800	5,970,900
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.028%	▲0.032%	▲0.032%	▲0.030%
									コール市場残高	121,340	123,446	145,084	141,065	143,570
									うち無担	101,734	102,456	124,594	120,310	121,711
									うちO/N	60,491	62,263	82,796	77,592	72,193
									うち有担	19,606	20,990	20,490	20,755	21,859

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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	2020/12/15			31,417	25,002	▲0.010		▲0.003	40.9
CP等買入	6,000	2020/12/17			10,524	5,999	▲0.039		▲0.011	24.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/14	2020/12/15	▲ 0.350	1,300	1,300		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/14	2020/12/15	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年12月15日の予定

*10月の石油等消費動態統計	*米国FOMC(1日目)	*国庫短期証券(959回)入札 (6ヶ月、38,000億円、12/16発行)
	*米国11月の鉱工業生産・設備稼働率	*流動性供給入札 (5,000億円、12/16発行)

◆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