

Central Daily Market Report

2020年12月15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15日		2020年12月16日		2020年12月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,900		▲ 2,000		▲ 3,000	
財政	77,100		▲ 39,500		2,000	
資金過不足	75,200		▲ 41,500		▲ 1,000	
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			3,500	▲ 1,900		
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		▲ 1,100		▲ 100	6,000	
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						
国債補充供給	▲ 100	1,300		100		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当増減	105,900		▲ 39,900		5,000	
当座預金残高	4,868,200		4,828,300		4,833,300	
準備預金残高	4,270,500					
積み終了先	4,270,500		12月16日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,270,500		積数		3,581,400	
非準備預金先	597,700		1日平均		115,500	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,581,400	
準備預金進捗率	実績	0.00%		日数	0.00%	

●2020年12月15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▲0.025~▲0.01%の出合いで始まった。積み最終日のため着地に向けた調達が増加し前日比でレートが上昇した。一巡後は▲0.06~▲0.01%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(12/16-12/17)は、▲0.085~▲0.07%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>

本日はTB6M物(959回)の入札が実施された。WI取引において▲0.090~▲0.086%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0922%、按分落札利回▲0.0902%と、順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.130%出合いと、強含みで推移した。この他に3M物が▲0.099%で出会った。

<CP市場>

CP発行市場はノンバンクで大型発行があり、償還総額は500億円程度に対し発行総額は1,400億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/15	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	
	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.071	0.000	▲ 0.010	26,687.84	▲ 44.60	104.01-02	104.06-07
T/N	▲ 0.001	0.000	▲ 0.001				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.018	▲ 0.023				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.035	▲ 0.015	▲ 0.026				-	▲ 0.084						
3W							-	▲ 0.098						
1M			0.130				-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.096	▲ 0.105						
6M							▲ 0.110	▲ 0.125						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.148						
日付		12/8	12/9	12/10	12/11	12/14								
日銀当預残	4,802,400	4,800,700	4,771,400	4,768,000	4,762,300									
準備預金残	4,203,200	4,191,800	4,163,300	4,180,500	4,216,900									
マネタリーベース	6,000,400	5,999,700	5,972,800	5,970,900	5,966,400									
無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.032%	▲0.032%	▲0.030%	▲0.028%									
コール市場残高	123,446	145,084	141,065	143,570	134,955									
うち無担	102,456	124,594	120,310	121,711	113,169									
うちO/N	62,263	82,796	77,592	72,193	73,426									
うち有担	20,990	20,490	20,755	21,859	21,786									

●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	959	-	38,000	2020/12/16	2021/6/16	129,289.0	31,059.7	100.0450	▲0.0902%	75.7519%	100.0460	▲0.0922%	6,940.0
流動性供給	323	-	5,000	2020/12/16		19,574.0	4,980.0		▲0.0070%	64.4760%		▲0.0080%	

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2020/12/16	2020/12/28		3,451	3,451				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/15	2020/12/16	▲ 0.350	103	103		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/15	2020/12/16	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/12/17	2020/12/24	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2020/12/17	2021/3/11	0.330	0	0				

●2020年12月16日の予定

*11月の貿易統計	*米国FOMC(2日目) *FRB 米経済見通し発表 *米国10月の企業在庫 *米国11月の小売売上高 *英国11月の消費者物価指数	*国庫短期証券(960回)入札 (1年、35,000億円、12/21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