Central Daily Market Report

2020年12月16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16日 需給速報		2020年12月17日 需給予想		2020年12月18日 当社予想	
銀行券	▲ 2,100		▲ 2,700		▲ 4,000	
財政	▲ 39,900		2,500		19,000	
資金過不足	▲ 42,000		▲ 200		15,000	
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						
国債買入			15,100			
CP等買入		▲ 100	6,000	▲ 500		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						▲ 100
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 1,000	100		1,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 41,400		21,400		14,900	

当座預金残高	4,826,800	4,848,200	4,863,100
準備預金残高	4,242,400		
積み終了先	2,872,900		
超過準備	1,158,200		
非準備預金先	584,400		

12月17日以降の残り所要積立額	
積数	497,200
1日平均	16,600

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 86.12%	日数	3.23%

●2020年12月16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▲0.06～▲0.018%の出合いで始まった。新積み期間に入り大手行の調達意欲は後退したものの、地銀業態では調達意欲は強く、▲0.02%台の出合いが中心となった。一巡後は▲0.075～▲0.035%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(12/17-12/18)は、▲0.08～▲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TB1Y物（960回）の入札が実施された。WI取引において▲0.108～▲0.105%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1101%、按分落札利回▲0.1081%と、WIを鑑みるとしっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.118～▲0.115%出合いと、堅調に推移した。この他に3M物が▲0.105%、6M物が▲0.105～▲0.096%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、不動産・機械・化学で大型発行があり、償還総額は2,400億円程度に対し発行総額は2,600億円程度となった。発行レートは概ねマイナス圏で、ほぼ横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/16	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.033				－	▲ 0.073
T/N	▲ 0.001	0.000	▲ 0.001				－	▲ 0.078
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.023				－	▲ 0.081
2W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.021				－	▲ 0.089
3W							－	▲ 0.095
1M			▲ 0.005				－	▲ 0.098
3M							▲ 0.096	▲ 0.104
6M							▲ 0.096	▲ 0.124
1Y							▲ 0.117	▲ 0.148

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）
0.005	0.005	26,757.40	69.56	103.64-65	103.44-45

日付	12/9	12/10	12/11	12/14	12/15
日銀当預残	4,800,700	4,771,400	4,768,000	4,762,300	4,868,200
準備預金残	4,191,800	4,163,300	4,180,500	4,216,900	4,270,800
マネタリーベース	5,999,700	5,972,800	5,970,900	5,966,400	6,074,300
無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.032%	▲0.030%	▲0.028%	▲0.023%
コール市場残高	145,084	141,065	143,570	134,955	133,796
うち無担	124,594	120,310	121,711	113,169	110,663
うちO/N	82,796	77,592	72,193	73,426	72,640
うち有担	20,490	20,755	21,859	21,786	23,133

●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	960	－	35,000	2020/12/21	2021/12/20	116,851.0	28,509.8	100.1080	▲0.1081%	48.2250%	100.1100	▲0.1101%	6,490.0

●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
国債買入（残存期間1年以下）	1,500	2020/12/17			2,717	1,501	0.006		0.011	79.9
国債買入（残存期間1年超3年以下）	5,000	2020/12/17			12,363	5,010	0.002		0.002	87.0
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2020/12/17			13,813	4,204	0.000		0.000	75.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,200	2020/12/17			13,691	4,204	0.001		0.010	27.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/12/16	2020/12/17	▲ 0.350	943	943		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/12/16	2020/12/17	▲ 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）
被災地金融支援オペ	第6回	2020/12/18	2022/11/18	0	41

●2020年12月17日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合（1日目、18日まで）
*英中銀MPC結果発表
*米国11月の住宅着工件数
*ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値
*国庫短期証券(961回)入札（3ヶ月、73,000億円、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