

Central Daily Market Report

2020年12月17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17日		2020年12月18日		2020年12月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,700		▲ 2,700		▲ 3,000	
財政	4,100		19,400		78,000	
資金過不足	1,400		16,700		75,000	
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	15,100					
CP等買入	6,000	▲ 500		▲ 1,300		
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				▲ 1,000		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	1,000		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	22,900		14,400		75,000	
当座預金残高	4,849,700		4,864,100		4,939,100	
準備預金残高	4,269,100					
積み終了先	4,220,100		12月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,819,700		積数		47,500	
非準備預金先	580,600		1日平均		1,600	
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	98.67%	日数	6.45%		

●2020年12月17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▲0.055~▲0.015%の出合いで始まった。前日より地銀業態の調達ニーズが強くなったことや、大手行が調達レートをやや上げたことで全体のレートが上昇した。一巡後は目立った出合いは無く、出し手の調整による散発的な出合いに留まった。ターム物は月内物の引き合いが複数見られた。

<レポ市場>

GCT/N(12/18-12/21)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2Y410~419、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TB3M物(961回)の入札が実施された。WI取引において▲0.100~▲0.097%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0942%、按分落札利回▲0.0893%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、▲0.096~▲0.093%出合いと、やや堅調に推移した。この他に6M物が▲0.102%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、食料品・卸売・海運業態で大型発行があり、償還総額は1,900億程度に対し発行総額は1,800億程度。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

2020/12/17	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.073	0.005	0.000	26,806.67	49.27	103.47-49	103.18-19		
T/N	▲ 0.010	0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.079								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.050	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.081								
2W							-	▲ 0.091								
3W							-	▲ 0.094								
1M							-	▲ 0.098								
3M							▲ 0.096	▲ 0.103								
6M							▲ 0.102	▲ 0.124								
1Y							▲ 0.117	▲ 0.148								
											日付	12/10	12/11	12/14	12/15	12/16
											日銀当預残	4,771,400	4,768,000	4,762,300	4,868,200	4,826,800
											準備預金残	4,163,300	4,180,500	4,216,900	4,270,800	4,242,400
											マネタリーベース	5,972,800	5,970,900	5,966,400	6,074,300	6,034,900
											無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.030%	▲0.028%	▲0.023%	▲0.033%
											コール市場残高	141,065	143,570	134,955	133,796	129,253
											うち無担	120,310	121,711	113,169	110,663	107,315
											うちO/N	77,592	72,193	73,426	72,640	66,847
											うち有担	20,755	21,859	21,786	23,133	21,938

●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	961	-	73,000	2020/12/21	2021/3/29	157,652.2	59,315.4	100.0240	▲0.0893%	98.8790%	100.0253	▲0.0942%	13,684.0

●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)		2020/12/17	2020/12/18	▲0.350	54	54		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/17	2020/12/18	▲0.350	0	0				

●2020年12月18日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁定例会見
- *11月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.9%)

◆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