

# Central Daily Market Report

2020年12月21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21日		2020年12月22日		2020年12月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,900		▲ 2,300		▲ 3,000	
財政	66,100		▲ 500		▲ 4,000	
資金過不足	64,200		▲ 2,800		▲ 7,000	
<b>金融調節</b>	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						
国庫短期証券買入			20,000			
国債買入			13,800			
CP等買入		▲ 600		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	100					
国債補完供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	63,900		30,600		▲ 7,000	
当座預金残高	4,928,000		4,958,600		4,951,600	
準備預金残高	4,349,300					
積み終了先	4,347,100		12月22日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,347,100		積数		9,900	
非準備預金先	578,700		1日平均		400	
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	99.72%	日数	19.35%		

## ●2020年12月21日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.05~▲0.015%での調達で始まった。先週末と同様強めの地合いとなり、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(12/22-12/23)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2Y410~419、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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペが前回より5,000億円減額の20,000億円でおファーされた。平均落札利回較差+0.001%、按分落札利回較差+0.000%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.104~▲0.103%、6M物が▲0.090%、1Y物が▲0.114%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、1,600億円弱の償還に対して、1,000億円弱の発行と償還超となった。大型発行は石油業態から見られた程度であった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/12/21	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.073	0.010	0.005	26,714.42	▲ 48.97	103.48-49	103.59-60
T/N	▲ 0.001	0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.015	▲ 0.021				-	▲ 0.080						
2W							-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.103	▲ 0.102						
6M							▲ 0.090	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.147						
									日付	12/14	12/15	12/16	12/17	12/18
									日銀当預残	4,762,300	4,868,200	4,826,800	4,849,700	4,864,100
									準備預金残	4,216,900	4,270,800	4,242,400	4,269,100	4,269,100
									マネタリーベース	5,966,400	6,074,300	6,034,900	6,060,600	6,077,700
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.023%	▲0.033%	▲0.027%	▲0.022%
									コール市場残高	134,955	133,796	129,253	134,008	137,014
									うち無担	113,169	110,663	107,315	111,139	114,760
									うちO/N	73,426	72,640	66,847	70,646	71,517
									うち有担	21,786	23,133	21,938	22,869	22,254

## ●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	応募総額(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	20,000	2020/12/22			45,446	20,005	0.000		0.001	93.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2020/12/22			10,466	5,001	▲0.007		▲0.003	8.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2020/12/22			13,517	4,206	0.000		0.001	34.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/12/22			12,810	4,204	▲0.003		▲0.001	36.1
国債買入(物価連動債)	300	2020/12/22			1,667	300	▲0.080		▲0.141	76.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/21	2020/12/22	▲0.350	94	94		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/21	2020/12/22	▲0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/12/24			3,388	2,000	0.061		0.094	0.4

## ●2020年12月22日の予定

*月例経済報告	*米国7-9月期のGDP確報値 *米国11月の中古住宅販売 *英国7-9月期のGDP確報値	*流動性供給入札 (5,000億円、12/23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