

Central Daily Market Report

2020年12月22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22日		2020年12月23日		2020年12月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,300		▲ 2,600		▲ 5,000	
財政	1,100		▲ 6,300		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 1,200		▲ 8,900		▲ 6,000	
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	20,000					
国債買入	13,800					
CP等買入		▲ 300		▲ 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			2,000	
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 400	100		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	31,800		▲ 8,800		▲ 4,000	
当座預金残高	4,959,800		4,951,000		4,947,000	
準備預金残高	4,358,700					
積み終了先	4,357,200		12月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,357,100		積数		8,200	
非準備預金先	601,100		1日平均		300	
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	99.77%		日数	22.58%	

●2020年12月22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▲0.045~▲0.01%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。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(12/23-12/24)は、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。SCI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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.103%、6M物が▲0.103%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は550億円程度であったものの、陸運・電機等から大型発行が実施されたため、発行総額は2,200億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/22	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	▲ 0.020				-	▲ 0.079	0.005	▲ 0.005	26,436.39	▲ 278.03	103.34-35	103.41-43
T/N	▲ 0.001	0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.015	0.500	0.094				-	▲ 0.092						
3W			0.001				-	▲ 0.094						
1M	0.010	0.250	0.130				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.103	▲ 0.102						
6M							▲ 0.102	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.146						
									日付	12/15	12/16	12/17	12/18	12/21
									日銀当預残	4,868,200	4,826,800	4,849,700	4,864,100	4,928,000
									準備預金残	4,270,800	4,242,400	4,269,100	4,269,100	4,339,800
									マネタリーベース	6,074,300	6,034,900	6,060,600	6,077,700	6,143,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.033%	▲ 0.027%	▲ 0.022%	▲ 0.022%
									コール市場残高	133,796	129,253	134,008	137,014	132,649
									うち無担	110,663	107,315	111,139	114,760	108,848
									うちO/N	72,640	66,847	70,646	71,517	63,230
									うち有担	23,133	21,938	22,869	22,254	23,801

●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)
流動性供給	324	-	5,000	2020/12/23		13,136.0	4,982.0		0.0000%	47.0443%		▲0.0020%	

●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)		2020/12/22	2020/12/23	▲ 0.350	118	118		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/22	2020/12/23	▲ 0.350	203	203		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/12/24	2021/1/7	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2020/12/24	2021/3/18	0.340	0	0				

●2020年12月23日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(10月28、29日分)
*10月の景気動向指数改訂状況

*米国11月の新築一戸建て販売件数
*米国11月の個人所得・消費支出

◆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