

Central Daily Market Report

2020年12月25日(金)

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25日		2020年12月28日		2020年12月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,100		▲ 2,900		▲ 1,000	
財政	9,200		▲ 1,300		▲ 2,000	
資金過不足	6,100		▲ 4,200		▲ 3,000	
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			4,700	▲ 3,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,100			
CP等買入		▲ 2,000		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別	99,700	▲ 98,400				
E T F 買入						
国債補充供給		300				
<small>※ドル資金供給用担保準備供給</small>						
当増減	5,600		6,300		▲ 3,000	
当座預金残高	4,952,000		4,958,300		4,955,300	
準備預金残高	4,362,700					
積み終了先	4,362,300		12月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,361,900		積数		2,000	
非準備預金先	589,300		1日平均		100	
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	99.94%	日数	38.71%		

●2020年12月25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▲0.035~▲0.01%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、週末要因も重なったことでレート水準は上昇した。一巡後は▲0.02%近辺での出合いが散見される程度で週末の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オベは20,000億円(12/28-1/13)オファーされ、応札額4,651億円(期落ち分3,451億円)と札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(12/28-12/29)は、▲0.09~▲0.075%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、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、小売・卸売・電機等の幅広い業態から大型発行が見られた。来週は休暇に入る事業法人も多く、年末・年始発行の案件も散見されたため、2,600億円程度の償還総額に対して、3,900億円弱の発行総額に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。また、本年最後となるCP等買入オベが、事前予定通り6,000億円でオファーされ、按分落札レート▲0.032%、平均落札レート▲0.022%と、按分落札レートは前回比で上昇したが、平均落札レートは低下する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/25	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.016				-	▲ 0.082	0.015	0.000	26,656.61	▲ 11.74	103.62-65	103.40-65
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.091						
2W			▲ 0.013				-	▲ 0.090						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.103	▲ 0.100						
6M							▲ 0.107	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.145						
									日付	12/18	12/21	12/22	12/23	12/24
									日銀当預残	4,864,100	4,928,000	4,959,800	4,950,100	4,946,400
									準備預金残	4,269,100	4,339,800	4,358,700	4,329,800	4,333,600
									マネタリーベース	6,077,700	6,143,500	6,177,600	6,170,600	6,171,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.021%
									コール市場残高	137,014	132,649	126,632	132,763	137,015
									うち無担	114,760	108,848	103,226	109,090	113,897
									うちO/N	71,517	63,230	57,258	62,532	67,119
									うち有担	22,254	23,801	23,406	23,673	23,118

●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	業分率	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	2020/12/28	2021/1/13		4,651	4,651				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2020/12/28			10,653	4,200	0.002		0.003	86.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/12/28			11,635	4,206	▲0.004		▲0.002	60.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/12/28			6,861	1,201	0.005		0.007	7.7
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/12/28			1,641	301	0.008		0.009	46.7
CP等買入	6,000	2020/12/30			11,735	5,975	▲0.032		▲0.022	41.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/25	2020/12/28	▲ 0.350	8	8		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/25	2020/12/28	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月28日の予定

*決定会合における主な意見(12月17・18日分)	*London祝日(Boxing Day, substitute)
*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+1.2%)	

◆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