

Central Daily Market Report

2020年12月28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28日		2020年12月29日		2020年12月30日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 3,000	▲ 2,600			▲ 600	
財政	▲ 3,200	▲ 3,800			▲ 1,900	
資金過不足	▲ 6,200	▲ 6,400			▲ 2,500	
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		▲ 800		▲ 600	6,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
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			100		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	4,200	▲ 6,900			3,500	
当座預金残高	4,956,200		4,949,300		4,952,800	
準備預金残高	4,347,500					
積み終了先	4,347,200					
超過準備	4,347,200					
非準備預金先	608,700					
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	99.96%	日数	41.94%		

●2020年12月28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▲0.04~▲0.01%での調達で始まった。一巡後は▲0.02%近辺での出会いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(12/29-12/30)は、▲0.085~▲0.075%程度での出会い。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、3M物が▲0.113%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、四半期末に該当する日であったことから償還総額が約15,000億円となった。その一方で、発行は、大型案件の入札が実施されたものの、全体の件数は伸びず総額約4,000億円弱にとどまった。発行レートは、玉確保の動きが積極的であることから低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/12/28	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.079	0.015	0.000	26,854.03	197.42	103.51-53	103.46-47
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.014	0.010	▲ 0.004				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.103	▲ 0.100						
6M							▲ 0.107	▲ 0.117						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.146						
日付	12/21	12/22	12/23	12/24	12/25									
日銀当預残	4,928,000	4,959,800	4,950,100	4,946,400	4,952,000									
準備預金残	4,339,800	4,358,700	4,329,800	4,333,600	4,362,700									
マネタリーベース	6,143,500	6,177,600	6,170,600	6,171,000	6,179,600									
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.020%	▲0.019%	▲0.021%	▲0.016%									
コール市場残高	132,649	126,632	132,763	137,015	139,994									
うち無担	108,848	103,226	109,090	113,897	118,031									
うちO/N	63,230	57,258	62,532	67,119	72,503									
うち有担	23,801	23,406	23,673	23,118	21,963									

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/12/28	2020/12/29	▲ 0.350	119	119		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/28	2020/12/29	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月29日の予定

*10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

◆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よう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