

Central Daily Market Report

2020年12月29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29日		2020年12月30日		2021年1月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,800		▲ 400		6,000	
財政	▲ 6,300		▲ 3,800		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 9,100		▲ 4,200		▲ 14,000	
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						
CP等買入		▲ 600	6,000	▲ 4,100		
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			500			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	▲ 9,800		▲ 1,600		▲ 14,000	
当座預金残高	4,946,400		4,944,800		4,930,800	
準備預金残高	4,363,000					
積み終了先	4,362,600					
超過準備	4,362,600					
非準備預金先	583,400					
12月30日以降の残り所要積立額						
積数					1,300	
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	99.96%	日数	45.16%		

●2020年12月29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%近辺での出合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合いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(12/30-1/4)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市場は、受渡日が年末を跨いでることから入札総額が1,000億円程度にとどまった。償還は無かった。発行レートは低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/12/29	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.074	0.020	0.005		27,568.15	714.12	103.69-70	103.68-69
T/N			▲ 0.017				-	▲ 0.079							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.013				-	▲ 0.082							
2W	▲ 0.025	▲ 0.003	▲ 0.019				-	▲ 0.086							
3W							-	▲ 0.090							
1M			0.001				-	▲ 0.094							
3M							▲ 0.103	▲ 0.100							
6M							▲ 0.107	▲ 0.116							
1Y							▲ 0.117	▲ 0.146							
日付		12/22	12/23	12/24	12/25	12/28									
日銀当預残		4,959,800	4,950,100	4,946,400	4,952,000	4,956,200									
準備預金残		4,358,700	4,329,800	4,333,600	4,362,700	4,348,600									
マネタリーベース		6,177,600	6,170,600	6,171,000	6,179,600	6,186,900									
無担O/N加重平均		▲0.020%	▲0.019%	▲0.021%	▲0.016%	▲0.019%									
コール市場残高		126,632	132,763	137,015	139,994	133,408									
うち無担		103,226	109,090	113,897	118,031	109,685									
うちO/N		57,258	62,532	67,119	72,503	66,007									
うち有担		23,406	23,673	23,118	21,963	23,723									

●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	棄分率	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)		2020/12/29	2020/12/30	▲ 0.350	168	168		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/29	2020/12/30	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月30日の予定

*証券取引所大納会

*米国12月のシカゴPM景況感指数

◆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