

Central Daily Market Report

2020年12月30日(水)

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30日		2021年1月4日		2021年1月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		3,600		6,000	
財政	▲ 3,200		▲ 20,500		2,000	
資金過不足	▲ 3,500		▲ 16,900		8,000	
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	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	▲ 3,200	200		3,200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 4,100		▲ 13,700		8,000	
当座預金残高	4,942,300		4,928,600		4,936,600	
準備預金残高	4,330,000					
積み終了先	4,330,000		1月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,329,800		積数		200	
非準備預金先	612,300		1日平均		0	
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	99.99%	日数	61.29%		

●2020年12月30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~▲0.01%での調達で始まった。一巡後は▲0.04~▲0.02%近辺での出合いが散見される程度で本年の取引を終えた。年末初を跨ぐ取引であるものの、ビッドは底堅く、レートの低下は限定的となった。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(1/4-1/5)は、▲0.085~▲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、多くの発行体が休暇入りしていることから、入札は無かった。償還額は約200億円であった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/30	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.102	0.020	0.000	27,444.17	▲ 123.98	103.55-56	103.32-34
T/N							-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.103	▲ 0.099						
6M							▲ 0.107	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.144						
									日付	12/23	12/24	12/25	12/28	12/29
									日銀当預残	4,950,100	4,946,400	4,952,000	4,956,200	4,946,400
									準備預金残	4,329,800	4,333,600	4,362,700	4,348,600	4,363,200
									マネタリーベース	6,170,600	6,171,000	6,179,600	6,186,900	6,179,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.021%	▲ 0.016%	▲ 0.019%	▲ 0.019%
									コール市場残高	132,763	137,015	139,994	133,408	134,717
									うち無担	109,090	113,897	118,031	109,685	113,037
									うちO/N	62,532	67,119	72,503	66,007	70,244
									うち有担	23,673	23,118	21,963	23,723	21,680

●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)		2020/12/30	2021/1/4	▲ 0.350	3,191	3,191		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/12/30	2021/1/4	▲ 0.350	17	17		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2021年1月4日の予定

*米国11月の建設支出

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願ひ申し上げます。

◆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