Central Daily Market Report

2020年12月1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1日 需給速報		2020年12月2日 需給予想		2020年12月3日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,100		▲ 2,000	
財政	▲ 34,500		▲ 97,300		11,000	
資金過不足	▲ 35,000		▲ 98,400		9,000	
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			1,900	▲ 1,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			30,000			
国債買入	6,100					
CP等買入		▲ 400		▲ 200		
貸出支援基金（成）			1,700	▲ 6,700		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 29,500		▲ 72,800		9,000	

当座預金残高	4,838,500	4,765,700	4,774,700
準備預金残高	4,264,800		
積み終了先	4,264,700		
超過準備	4,264,500		
非準備預金先	573,700		

12月2日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	0

積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			3,451,500
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数 53.33%

●2020年12月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末要因が剥落したことでビッドサイドの参加者が増加したため、前日比やや高めの出合いとなった。立ち上がりは都銀業態から▲0.05～▲0.045%、地銀・証券業態などから▲0.035～▲0.015%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.075～▲0.02%で出合いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は、1～2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(12/2-12/3)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、20Y167～173、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、短国買入オペが前回から5,000億円増額の30,000億円と市場予想を上回る額でオファーされた。平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+0.003%と、やや弱めの結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.090%、6M物が▲0.098～▲0.095%、1Y物が▲0.130～▲0.126%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額150億円程度に対して、発行総額は850億円程度と発行超であった。一部の石油業態において大型発行が見られたものの、案件は少なく、比較的閑散としたマーケットであった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/12/1	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.030				－	▲ 0.076
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				－	▲ 0.080
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.017				－	▲ 0.083
2W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.017				－	▲ 0.084
3W							－	▲ 0.090
1M							－	▲ 0.102
3M							▲ 0.090	▲ 0.108
6M							▲ 0.098	▲ 0.131
1Y							▲ 0.129	▲ 0.155

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.015	▲ 0.010	26,787.54	353.92	104.29-31	104.33-34

日付	11/24	11/25	11/26	11/27	11/30
日銀当預残	4,807,900	4,836,000	4,828,600	4,868,100	4,868,000
準備預金残	4,213,500	4,232,400	4,256,900	4,276,100	4,287,900
マネタリーベース	5,996,000	6,024,300	6,018,300	6,058,800	6,059,200
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.030%	▲0.030%	▲0.030%	▲0.032%
コール市場残高	126,824	124,414	128,556	140,869	119,713
うち無担	104,410	102,138	106,857	120,085	100,290
うちO/N	65,392	61,220	65,459	79,647	60,852
うち有担	22,414	22,276	21,699	20,784	19,423

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
10年利付国債	360	0.10%	26,000	2020/12/2	2030/9/20	71,770.0	20,956.0	100.7700	**0.0210%**	**69.6232%**	100.7900	**0.0190%**	5,032.0

●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	2020/12/2	2020/12/16		1,851	1,851				
国庫短期証券買入	30,000	2020/12/2			56,847	30,007	0.003		0.005	93.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/12/1	2020/12/2	▲ 0.350	283	283		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/12/1	2020/12/2	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/12/3	2020/12/10	0.330	0	0				
米ドル資金供給		2020/12/3	2021/2/26	0.330	0	0				

●2020年12月2日の予定

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
*11月のマネタリーベース
*11月の消費動向調査
*米国ベージュブック

◆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。
◆本資料は何ら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論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