Central Daily Market Report

2020年12月24日（木）
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24日 需給速報		2020年12月25日 需給予想		2020年12月28日 当社予想	
銀行券	▲ 4,100		▲ 3,000		▲ 1,000	
財政	▲ 900		9,100		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 5,000		6,100		▲ 2,000	
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						▲ 3,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 2,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	2,000			▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別			99,700	▲ 98,400		
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	200		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 3,700		5,600		▲ 5,500	

当座預金残高	4,946,400	4,952,000	4,946,500
準備預金残高	4,334,400		
積み終了先	4,332,500		
超過準備	4,332,500		
非準備預金先	612,000		

12月25日以降の残り所要積立額	
積数	4,400
1日平均	200

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 99.88%	日数	29.03%

●2020年12月24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～▲0.015%での調達で始まった。引き続き調達意欲は強く、一巡後も▲0.015%近辺での出合いが数件見られ、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>

GCT/N(12/25-12/28)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、3M物が▲0.105%、1Y物が▲0.112%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は石油業態等からまとまった発行が実施されたものの、償還総額5,200億円程度に対して、発行総額は2,900億円程度にとどまり、前日に引き続き大幅な償還超のマーケットとなった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2020/12/24	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.021				－	▲ 0.082
T/N	▲ 0.040	0.005	▲ 0.003				－	▲ 0.085
S/N							－	－
1W			0.010				－	▲ 0.091
2W			▲ 0.014				－	▲ 0.092
3W							－	▲ 0.095
1M							－	▲ 0.096
3M							▲ 0.103	▲ 0.102
6M							▲ 0.107	▲ 0.123
1Y							▲ 0.117	▲ 0.146

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	26,668.35	143.56	103.52-54	103.56-58

日付	12/17	12/18	12/21	12/22	12/23
日銀当預残	4,849,700	4,864,100	4,928,000	4,959,800	4,950,100
準備預金残	4,269,100	4,269,100	4,339,800	4,358,700	4,329,800
マネタリーベース	6,060,600	6,077,700	6,143,500	6,177,600	6,170,600
無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.022%	▲0.022%	▲0.020%	▲0.019%
コール市場残高	134,008	137,014	132,649	126,632	132,763
うち無担	111,139	114,760	108,848	103,226	109,090
うちO/N	70,646	71,517	63,230	57,258	62,532
うち有担	22,869	22,254	23,801	23,406	23,673

●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)
2年利付国債	420	0.10%	30,000	2021/1/4	2023/1/1	107,097.0	25,624.00	100.4550	**▲0.1270%**	**65.4173%**	100.4580	**▲0.1290%**	4,368.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/12/24	2020/12/25	▲ 0.350	330	330		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/12/24	2020/12/25	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）	(参考) 2020/12/25時点の貸出残高（億円）
新型コロナ対応金融支援特別	2020/12/25	2021/6/25	0	99,697	516,246

●2020年12月25日の予定

*11月の完全失業率（市場予想：3.1%）
*11月の有効求人倍率（市場予想：1.04倍）
*12月の都区部消費者物価指数（市場予想:前年同月比（除く生鮮）▲0.8%）
*11月の商業動態統計速報
*11月の住宅着工統計

*New York、EURO、London祝日
(Christmas Day)

◆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