

Central Daily Market Report

2021年12月20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	2021年12月20日		2021年12月21日		2021年12月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 2,700		▲ 3,000	
財政	72,100		▲ 5,900		0	
資金過不足	70,100		▲ 8,600		▲ 3,000	
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						▲ 2,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 600				
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	69,200		▲ 7,800		▲ 5,500	
当座預金残高	5,376,100		5,368,300		5,362,800	
準備預金残高	4,766,700					
積み終了先	4,766,200		12月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,766,100		積数		4,900	
非準備預金先	609,400		1日平均		200	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,769,300	
準備預金進捗率	実績	99.87%	日数	16.13%		

●2021年12月20日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落し、一部でレートを切り下げる動きが見られたものの、調達意欲は堅調で高止まりとなった。立ち上がりは邦銀・外銀より、▲0.05～▲0.001%の出合い。一巡後は▲0.06～▲0.01%で調達が見られた。ターム物は月内物の引き合いが見られた程度であった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.085～▲0.080%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。

＜短国市場＞

20日は短国買入オベが前回と同額(1,000億円)でオファーされ、弱めの結果となった。アウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物に出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態から大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/12/20	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.084	0.035	▲ 0.009	27,937.81	▲ 607.87	113.51-52	113.45-47
T/N	▲ 0.043	▲ 0.010	▲ 0.026				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.099						
1M			0.005				-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.118	▲ 0.110						
6M							▲ 0.115	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.116	▲ 0.131						
									日付	12/13	12/14	12/15	12/16	12/17
									日銀当預残	5,239,100	5,251,900	5,341,300	5,307,600	5,306,900
									準備預金残	4,654,700	4,665,200	4,753,200	4,693,900	4,700,600
									マネタリーベース	6,476,800	6,491,700	6,583,300	6,553,000	6,554,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.014%	▲ 0.022%	▲ 0.033%	▲ 0.028%
									コール市場残高	154,740	163,780	160,027	192,164	196,015
									うち無担	136,932	145,813	141,874	174,171	177,390
									うちO/N	60,479	72,310	68,846	99,063	101,947
									うち有担	17,808	17,967	18,153	17,993	18,625

●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	案分率	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
国庫短期証券買入	1,000	2021/12/21			9,618	1,001	0.005		0.008	14.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/20	2021/12/21	▲ 0.350	65	65		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/20	2021/12/21	▲ 0.350	0	0				

●2021年12月21日の予定

*月例経済報告

◆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