

Central Daily Market Report

2020年11月2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	2020年11月2日 需給速報	2020年11月4日 需給予想	2020年11月5日 当社予想
銀行券	▲ 300	800	1,000
財政	▲ 37,000	▲ 13,100	▲ 30,000
資金過不足	▲ 37,300	▲ 12,300	▲ 29,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,600	▲ 2,800	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	13,100		
CP等買入		▲ 300	▲ 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	700		
国債補完供給	▲ 100		100
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 25,100	▲ 12,300	▲ 29,000
当座預金残高	4,868,100	4,855,800	4,826,800
準備預金残高	4,272,300		
積み終了先	4,272,300		11月4日以降の残り所要積立額
超過準備	4,272,300		積数
非準備預金先	595,800		1日平均
			0
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額			3,537,500
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			61.29%

●2020年11月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.05~▲0.02%程度の出合いが見られた。業態ごとにレート水準の差はあるものの、調達サイドは総じてしっかりとした地合いとなった。ターム物は、ショートターム物で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(11/4-11/5)は、▲0.095~▲0.085%程度での出合い。SCはローラー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2Y402~417、5Y136~145、10Y340~360、20Y171~174、30Y59~68、40Y9~13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、6M物が▲0.104%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は輸送機器業態において大型発行が実施された。償還総額300億円程度に対して、発行総額は700億円程度と発行超となった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.086	0.040	0.005	23,295.48	318.35	104.57-59	104.84-85
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.092						
1M	▲ 0.025	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.101						
3M	0.030	0.080	0.055				▲ 0.090	▲ 0.111						
6M							▲ 0.104	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.159						
									日付	10/26	10/27	10/28	10/29	10/30
									日銀当預残	4,849,000	4,864,300	4,891,100	4,896,400	4,893,200
									準備預金残	4,268,100	4,273,900	4,288,600	4,279,400	4,273,600
									マネタリーベース	6,036,600	6,051,900	6,079,200	6,085,400	6,082,700
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.019%	▲0.024%	▲0.026%	▲0.029%
									コール市場残高	130,495	120,275	125,701	127,836	134,487
									うち無担	110,951	98,993	107,088	108,529	114,430
									うちO/N	60,038	55,980	62,575	62,516	71,397
									うち有担	19,544	21,282	18,613	19,307	20,057

●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)		2020/11/2	2020/11/4	▲ 0.350	44	44		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/2	2020/11/4	▲ 0.350	40	40		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年11月3日の予定

*文化の日	*米国9月の製造業新規受注・出荷・在庫
-------	---------------------

●2020年11月4日の予定

*10月実績/11月見込み財政資金対民間収支	*米国FOMC(1日目)	*10年利付国債入札
*金融政策決定会合議事要旨(9月16・17日開催分)	*米国9月の貿易収支	(26,000億円、11/5借入)
*10月のマネタリーベース	*米国10月のISM非製造業景況指数	

◆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