

Central Daily Market Report

2020年11月4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11月4日		2020年11月5日		2020年11月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		▲ 200		0	
財政	▲ 10,300		▲ 20,700		2,000	
資金過不足	▲ 9,500		▲ 20,900		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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			15,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
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						
国債補完供給	▲ 900	100		900		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 10,400		▲ 5,600		2,000	
当座預金残高	4,857,700		4,852,100		4,854,100	
準備預金残高	4,241,600					
積み終了先	4,241,500				11月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,241,500				積数	100
非準備預金先	616,100				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	100.00%	日数	64.52%		

●2020年11月4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%の出会いで始まった。一巡後もビッド水準に大きな変化はなかったが、一部で▲0.06%台の出会いも散見された。業態ごとにレート水準に差はあるものの、引き続き調達サイドはしっかりとした印象であった。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(11/5-11/6)は、▲0.12~▲0.10%程度での出会い。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>

本日は短国買入オペが前回から10,000億円減額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.000%、按分落札利回較差▲0.004%と、ややしっかりした結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.092~▲0.088%、1Y物が▲0.135%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は建設業態においてまとまった発行が実施された。償還総額280億円程度に対して、発行総額は600億円程度と発行超となった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/4	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.097	0.035	▲ 0.005	23,695.23	399.75	104.54-56	104.87-89
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.020	0.020	▲ 0.011				-	▲ 0.096						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.093	▲ 0.113						
6M							▲ 0.104	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.159						
日付		10/27	10/28	10/29	10/30	11/2								
日銀当預残		4,864,300	4,891,100	4,896,400	4,893,200	4,868,100								
準備預金残		4,273,900	4,288,600	4,279,400	4,273,600	4,268,400								
マネタリーベース		6,051,900	6,079,200	6,085,400	6,082,700	6,058,000								
無担O/N加重平均		▲ 0.019%	▲ 0.024%	▲ 0.026%	▲ 0.029%	▲ 0.030%								
コール市場残高		120,275	125,701	127,836	134,487	140,726								
うち無担		98,993	107,088	108,529	114,430	120,001								
うちO/N		55,980	62,575	62,516	71,397	78,618								
うち有担		21,282	18,613	19,307	20,057	20,725								

●入札結果

名称	回数	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1非価格競争入札(億円)
10年利付国債	360	0.10%	26,000	2020/11/5	2030/9/20	86,580.0	20,989.0	100.5200	0.0470%	73.1880%	100.5300	0.0460%	4,981.0

●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
国庫短期証券買入	15,000	2020/11/5			34,944	15,004	▲0.004		0.000	4.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/11/4	2020/11/5	▲ 0.350	856	856		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/4	2020/11/5	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/11/6	2020/11/13	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2020/11/6	2021/1/28	0.330	0	0				

●2020年11月5日の予定

*11月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国FOMC(2日目) *英中銀MPC結果発表	*交付税特別会計借入 (11,000億円、11/13借入)
--------------------	-----------------------------	----------------------------------

◆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