

Central Daily Market Report

2020年11月5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11月5日 需給速報	2020年11月6日 需給予想	2020年11月9日 当社予想
銀行券	▲ 100	300	1,000
財政	▲ 20,800	900	▲ 22,000
資金過不足	▲ 20,900	1,200	▲ 21,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		9,600	
CP等買入		▲ 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		▲ 100	3,000
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 500	900	500
※ドル資金供給用担保提供供給			
当増減	▲ 6,100	10,900	▲ 18,000
当座預金残高	4,851,600	4,862,500	4,844,500
準備預金残高	4,249,200		
積み終了先	4,249,100		11月6日以降の残りに所要積立額
超過準備	4,249,100		積数 100
非準備預金先	602,400		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 67.74%

●2020年11月5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▲0.04~▲0.02%の出会いで始まった。引き続き調達ニーズが強く、一巡後もビッド水準に大きな変化は見られなかったものの、一部で▲0.06~▲0.05%台の出会いも散見された。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(11/6-11/7)は、▲0.105~▲0.09%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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.095~▲0.094%、1Y物が▲0.140%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。償還総額10億円程度に対して、発行総額は100億円程度と発行超となった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/5	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	
	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	▲ 0.031				-	▲ 0.094	0.015	▲ 0.020	24,105.28	410.05	104.43-44	104.30-32
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.096						
2W							-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.095	▲ 0.113						
6M							▲ 0.104	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.159						
									日付	10/28	10/29	10/30	11/2	11/4
									日銀当預残	4,891,100	4,896,400	4,893,200	4,868,100	4,857,700
									準備預金残	4,288,600	4,279,400	4,273,600	4,268,400	4,242,400
									マネタリーベース	6,079,200	6,085,400	6,082,700	6,058,000	6,046,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.024%	▲ 0.026%	▲ 0.029%	▲ 0.030%	▲ 0.032%
									コール市場残高	125,701	127,836	134,487	140,726	125,732
									うち無担	107,088	108,529	114,430	120,001	106,368
									うちO/N	62,575	62,516	71,397	78,618	65,235
									うち有担	18,613	19,307	20,057	20,725	19,364

●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1非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	11,000	2020/11/3	2021/5/14	315,215.0	11,000.12		0.0000%	3.4898%		0.0000%	

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2020/11/6			8,979	5,001	▲0.010		▲0.007	76.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2020/11/6			10,189	4,204	▲0.014		▲0.013	69.4
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/11/6			1,191	303	▲0.019		▲0.018	35.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/11/5	2020/11/6	▲ 0.350	487	487		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/5	2020/11/6	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3,000	2020/11/9			6,969	3,001	▲0.034		▲0.028	18.1

●2020年11月6日の予定

*9月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲10.7%)	*米国9月の卸売売上高	*国庫短期証券(949回)入札 (3ヶ月、75,500億円、11/9発行)
*9月の毎月勤労統計調査速報	*米国10月の雇用統計	*10Y物価連動国債入札 (2,000億円、11/9借入)
	*米国9月の消費者信用残高	

◆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