Central Daily Market Report

2020年11月6日（金）
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6日 需給速報		2020年11月9日 需給予想		2020年11月10日 当社予想	
銀行券	300		700		1,000	
財政	▲ 1,300		▲ 20,500		▲ 20,000	
資金過不足	▲ 1,000		▲ 19,800		▲ 19,000	
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						
国債買入	9,600					
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		▲ 100	3,000			
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 700	500		700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	8,000		▲ 16,200		▲ 19,000	

当座預金残高	4,859,600	4,843,400	4,824,400
準備預金残高	4,233,600		
積み終了先	4,233,600		
超過準備	4,233,600		
非準備預金先	626,000		

11月9日以降の残り所要積立額	
積数	100
1日平均	0

積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			3,545,200
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 77.42%

●2020年11月6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～▲0.015%の出合いで始まった。引き続き調達ニーズが強く、3日積み要因も加わりレートはやや上昇した。一巡後はビッド水準に大きな変化は見られなかったものの、一部▲0.06～▲0.05%台の出合いも散見された。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(11/9-11/10)は、▲0.095～▲0.085%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TB3M物（949回）の入札が実施された。WI取引において▲0.085%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.0878%、按分落札利回▲0.0837%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.100～▲0.094%出合いと堅調に推移した。その他に、6M物が▲0.110～▲0.108%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場はその他金融業態において大型発行が実施された。償還総額330億円程度に対して、発行総額は650億円程度と発行超となった。発行レートは概ねマイナス圏で、引き続き横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/11/6	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.029				－	▲ 0.091
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.020				－	▲ 0.090
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.012	▲ 0.021				－	▲ 0.092
2W							－	▲ 0.094
3W			0.025				－	▲ 0.097
1M							－	▲ 0.101
3M							▲ 0.097	▲ 0.112
6M							▲ 0.109	▲ 0.135
1Y							▲ 0.145	▲ 0.158

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	0.000	24,325.23	219.95	103.60-62	103.42-43

日付	10/29	10/30	11/2	11/4	11/5
日銀当預残	4,896,400	4,893,200	4,868,100	4,857,700	4,851,600
準備預金残	4,279,400	4,273,600	4,268,400	4,242,400	4,249,200
マネタリーベース	6,085,400	6,082,700	6,058,000	6,046,700	6,040,700
無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.029%	▲0.030%	▲0.032%	▲0.031%
コール市場残高	127,836	134,487	140,726	125,732	130,104
うち無担	108,529	114,430	120,001	106,368	107,788
うちO/N	62,516	71,397	78,618	65,235	64,605
うち有担	19,307	20,057	20,725	19,364	22,316

●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)
国庫短期証券	949	－	75,500	2020/11/9	2021/2/15	211,807.0	61,384.5	100.0225	**▲0.0837%**	**4.9642%**	100.0236	**▲0.0878%**	14,115.0
物価連動10年	25	0.20%	2,000	2020/11/9	2030/3/10	6,614.0	1,996.0	101.5500	**0.0330%**	**93.0348%**			

●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）		2020/11/6	2020/11/9	▲ 0.350	493	493		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/6	2020/11/9	▲ 0.350	186	186		▲0.350	▲0.350	

●2020年11月9日の予定

*決定会合における主な意見（10月28・29日分）
*9月の景気動向指数速報
*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*国庫短期証券（950回）入札
（6ヶ月、38,000億円、11/10発行）

◆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