

Central Daily Market Report

2020年11月9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9日 需給速報	2020年11月10日 需給予想	2020年11月11日 当社予想
銀行券	700	600	0
財政	▲ 21,000	▲ 22,100	▲ 9,000
資金過不足	▲ 20,300	▲ 21,500	▲ 9,000
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		7,300	
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	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	▲ 700	700	700
※ドル資金供給用担保確保供給			
当預増減	▲ 17,400	▲ 14,100	▲ 9,000
当座預金残高	4,842,200	4,828,100	4,819,100
準備預金残高	4,230,700		
積み終了先	4,230,600		11月10日以降の残り所要積立額
超過準備	4,230,600		積数 0
非準備預金先	611,500		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 80.65%

●2020年11月9日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態を中心に▲0.05~▲0.02%での調達で始まった。また、一部業態で試し取りが実施された。一巡後は▲0.04%近辺の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GC T/N(11/10-11/11)は、▲0.085~▲0.08%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＞

TB6M物(950回)の入札が実施された。WI取引において▲0.113~▲0.109%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1128%、按分落札利回▲0.1068%と、順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.113~▲0.109%出合いと、入札と同水準での推移となった。この他に、3M物が▲0.098~▲0.097%、1Y物が▲0.150%で出合った。

＜CP市場＞

CP市場は、償還200億円弱に対して、発行は少額にとどまり、閑散としていた。

●短期金融市場関連指標

2020/11/9	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買差額	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.070	0.030	▲ 0.030				-	▲ 0.091	0.015	0.000	24,839.84	514.61	103.25-27	103.50-51
T/N	▲ 0.045	0.030	▲ 0.015				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.090						
2W							-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.024				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.098	▲ 0.112						
6M							▲ 0.113	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.157						
									日付	10/30	11/2	11/4	11/5	11/6
									日銀当預残	4,893,200	4,868,100	4,857,700	4,851,600	4,859,600
									準備預金残	4,273,600	4,268,400	4,242,400	4,249,200	4,233,700
									マネタリーベース	6,082,700	6,058,000	6,046,700	6,040,700	6,048,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.030%	▲ 0.032%	▲ 0.031%	▲ 0.029%
									コール市場残高	134,487	140,726	125,732	130,104	154,269
									うち無担	114,430	120,001	106,368	107,788	134,214
									うちO/N	71,397	78,618	65,235	64,605	77,481
									うち有担	20,057	20,725	19,364	22,316	20,055

●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)
国庫短期証券	950	-	38,000	2020/11/10	2021/5/10	108,887.0	30,959.6	100.0530	▲0.1068%	44.6363%	100.0560	▲0.1128%	7,040.0

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2020/11/10			3,523	1,502	0.001		0.005	57.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/11/10			10,193	4,207	0.006		0.008	30.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/11/10			4,056	1,208	0.013		0.014	84.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/11/9	2020/11/10	▲ 0.350	725	725		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/9	2020/11/10	▲ 0.350	0	0				

●2020年11月10日の予定

*9月の国際収支	*30年利付国債入札
*9月の特定サービス産業動態統計速報	(9,000億円、11/11発行)
*10月の景気ウォッチャー調査	

◆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