

Central Daily Market Report

2020年11月10日(火)

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10日		2020年11月11日		2020年11月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		1,000		0	
財政	▲ 20,200		▲ 9,200		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 19,700		▲ 8,200		▲ 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						
国債買入	7,300					
CP等買入		▲ 600		▲ 300	5,500	
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	▲ 800	700		800		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 13,100		▲ 7,700		3,500	
当座預金残高	4,829,100		4,821,400		4,824,900	
準備預金残高	4,238,400					
積み終了先	4,238,400		11月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,238,400		積数		0	
非準備預金先	590,700		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	83.87%		

●2020年11月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.05~▲0.02%での調達で始まった。前日比でレート水準に大きな変化はなく、一巡後も▲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(11/11-11/12)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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.097~▲0.095%、6M物が▲0.114~▲0.112%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は電気機器業態で大型発行があり、発行、償還ともに1,000億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入オペが、当初予定より500億円少ない5,500億円でオファーされた。オファー額は減少したものの、応札額が前回(前回は10,604億円)より減少したこととあって、平均落札レート▲0.034%、按分レート▲0.055%と、前回比で平均、按分ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2020/11/10	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.084	0.030	0.015	24,905.59	65.75	105.13-14	105.04-05
T/N	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.018	▲ 0.022				-	▲ 0.090						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.101						
3M							▲ 0.097	▲ 0.112						
6M							▲ 0.115	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.139	▲ 0.157						
									日付	11/2	11/4	11/5	11/6	11/9
									日銀当預残	4,868,100	4,857,700	4,851,600	4,859,600	4,842,200
									準備預金残	4,268,400	4,242,400	4,249,200	4,233,700	4,231,100
									マネタリーベース	6,058,000	6,046,700	6,040,700	6,048,500	6,030,400
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.032%	▲0.031%	▲0.029%	▲0.030%
									コール市場残高	140,726	125,732	130,104	154,269	142,114
									うち無担	120,001	106,368	107,788	134,214	121,665
									うちO/N	78,618	65,235	64,605	77,481	73,727
									うち有担	20,725	19,364	22,316	20,055	20,449

●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)
30年利付国債	68	0.60%	9,000	2020/11/11	2050/9/20	27,491.0	7,307.0	98.8500	0.6450%	79.7183%	98.9100	0.6430%	1,680.0

●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
CP等買入	5,500	2020/11/12			7,033	5,493	▲0.055		▲0.034	60.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/11/10	2020/11/11	▲ 0.350	752	752		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/10	2020/11/11	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/11/13	2020/11/19	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2020/11/13	2021/2/4	0.330	0	0				

●2020年11月11日の予定

*10月のマネーストック	*New York祝日(Veterans Day)	*交付税特別会計借入(11,000億円、11/19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