

Central Daily Market Report

2020年11月11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11日 | | 2020年11月12日 | | 2020年11月13日 | |
|-------------------------|-------------|---------|-------------|--------|------------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 900 | | ▲ 200 | | ▲ 1,000 | |
| 財政 | ▲ 8,300 | | 4,000 | | ▲ 24,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 7,400 | | 3,800 | | ▲ 25,000 | |
| 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 | | | 13,900 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 300 | 5,500 | ▲ 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 | | | 100 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 300 | 800 | | 300 | | |
| *ドル資金供給用担保提供供給 | | | | | | |
| 当預増減 | ▲ 7,200 | | 38,100 | | ▲ 25,000 | |
| 当座預金残高 | 4,821,900 | | 4,860,000 | | 4,835,000 | |
| 準備預金残高 | 4,232,600 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,232,600 | | | | 11月12日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,232,600 | | | | 積数 | 0 |
| 非準備預金先 | 589,300 | | | | 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 | 87.10% | | |

●2020年11月11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。引き続き地合いに変化はなく、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。本日は3市場合同BCP共同訓練の一環として、固定金利方式による共通担保資金供給オペ(O/N)物が1,000億円オファーされ、48億円の落札となった。

<レポ市場>

GCT/N(11/12-11/13)は、▲0.09~▲0.07%程度での出合い。SCI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、短国買入オペが前回と同額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.005%、按分落札利回り較差+0.003%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.102~▲0.097%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は機械業で大型発行があり、償還総額は400億円程度に対し発行総額は800億円程度。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

| 2020/11/11 | 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 | ▲ 0.070 | 0.001 | ▲ 0.034 | | | | - | ▲ 0.083 | 0.035 | 0.005 | 25,349.60 | 444.01 | 105.25-27 | 105.39-41 |
| T/N | ▲ 0.055 | ▲ 0.001 | ▲ 0.016 | | | | - | ▲ 0.090 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.020 | ▲ 0.010 | ▲ 0.019 | | | | - | ▲ 0.089 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.020 | 0.010 | ▲ 0.005 | | | | - | ▲ 0.092 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.094 | | | | | | |
| 1M | ▲ 0.040 | 0.001 | ▲ 0.037 | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.102 | ▲ 0.111 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.115 | ▲ 0.132 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.139 | ▲ 0.157 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 11/4 | 11/5 | 11/6 | 11/9 | 11/10 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 4,857,700 | 4,851,600 | 4,859,600 | 4,842,200 | 4,829,100 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 4,242,400 | 4,249,200 | 4,233,700 | 4,231,100 | 4,238,400 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 6,046,700 | 6,040,700 | 6,048,500 | 6,030,400 | 6,016,800 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.032% | ▲ 0.031% | ▲ 0.029% | ▲ 0.030% | ▲ 0.034% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 125,732 | 130,104 | 154,269 | 142,114 | 136,511 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 106,368 | 107,788 | 134,214 | 121,665 | 116,380 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 65,235 | 64,605 | 77,481 | 73,727 | 75,597 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 19,364 | 22,316 | 20,055 | 20,449 | 20,131 |

●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 | 2020/11/19 | 2021/5/21 | 309,367.0 | 11,000.19 | | 0.0000% | 3.5558% | | 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 |
|---------------------------|----------------|------------|------------|---------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国庫短期証券買入 | 15,000 | 2020/11/12 | | | 39,647 | 15,003 | 0.003 | | 0.005 | 82.7 |
| 国債買入(残存期間1年超3年以下) | 5,000 | 2020/11/12 | | | 13,108 | 5,003 | 0.006 | | 0.009 | 35.2 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下) | 4,200 | 2020/11/12 | | | 10,373 | 4,204 | 0.006 | | 0.007 | 98.4 |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,200 | 2020/11/12 | | | 9,836 | 4,205 | 0.003 | | 0.005 | 78.7 |
| 国債買入(物価連動債) | 300 | 2020/11/12 | | | 1,450 | 301 | ▲ 0.050 | | ▲ 0.113 | 40.0 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2020/11/11 | 2020/11/12 | ▲ 0.350 | 276 | 276 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2020/11/11 | 2020/11/12 | ▲ 0.350 | 0 | 0 | | | | |
| 共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞・即日 | 1,000 | 2020/11/11 | 2020/11/12 | | 48 | 48 | | | | |

●2020年11月12日の予定

- *安達日銀審議委員、長野県金融経済懇談会において講演
- *9月の機械受注統計(市場予想:電力除く民需、前月比▲0.7%)
- *9月の第3次産業活動指数
- *10月の企業物価指数
- *米国10月の財政収支
- *米国10月の消費者物価指数
- *英国7-9月期のGDP速報値
- *5年利付国債入札(25,000億円、11/13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