Central Daily Market Report

2020年11月12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12日 需給速報		2020年11月13日 需給予想		2020年11月16日 当社予想	
銀行券	▲ 300		200		1,000	
財政	4,200		▲ 24,100		▲ 34,000	
資金過不足	3,900		▲ 23,900		▲ 33,000	
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	5,500	▲ 500		▲ 700		
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						
ＥＴＦ買入	100		100			
国債補完供給	▲ 1,100	300		1,100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	37,100		▲ 23,400		▲ 33,000	

当座預金残高	4,859,000	4,835,600	4,802,600
準備預金残高	4,259,000		
積み終了先	4,259,000		
超過準備	4,259,000		
非準備預金先	600,000		

11月13日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 90.32%

●2020年11月12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。積み最終日の前日を迎えたが、取り上がるような動きは見られず、一巡後も▲0.04%近辺の出合いが数件見られる程度で、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(11/13-11/16)は、▲0.085～▲0.075%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、6M物が▲0.115～▲0.110%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は電気機器、卸売、不動産業態で大型発行があり、償還総額は3.900億円程度に対し発行総額は2,900億円程度であった。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

2020/11/12	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.034				－	▲ 0.086
T/N	▲ 0.055	▲ 0.001	▲ 0.022				－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.018	▲ 0.022				－	▲ 0.089
2W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.020				－	▲ 0.090
3W							－	▲ 0.094
1M	▲ 0.030	0.013	0.002				－	▲ 0.100
3M			0.005				▲ 0.102	▲ 0.111
6M							▲ 0.115	▲ 0.134
1Y							▲ 0.139	▲ 0.157

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）
0.025	▲ 0.010	25,520.88	171.28	105.41-42	105.27-29

日付	11/5	11/6	11/9	11/10	11/11
日銀当預残	4,851,600	4,859,600	4,842,200	4,829,100	4,821,900
準備預金残	4,249,200	4,233,700	4,231,100	4,238,400	4,232,700
マネタリーベース	6,040,700	6,048,500	6,030,400	6,016,800	6,008,700
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.029%	▲0.030%	▲0.034%	▲0.034%
コール市場残高	130,104	154,269	142,114	136,511	130,486
うち無担	107,788	134,214	121,665	116,380	110,073
うちO/N	64,605	77,481	73,727	75,597	69,155
うち有担	22,316	20,055	20,449	20,131	20,413

●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)
5年利付国債	145	0.10%	25,000	2020/11/13	2025/9/20	71,794.0	20,368.00	101.0000	▲0.1050%	87.5921%	101.0000	▲0.1050%	4,613.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/11/12	2020/11/13	▲ 0.350	684	684		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/12	2020/11/13	▲ 0.350	372	372		▲0.350	▲0.350	

●2020年11月13日の予定

*米国10月の生産者物価指数
*米国11月のミシガン大消費者信頼感指数速報
*ユーロ圏7-9月期のGDP2次速報
*国庫短期証券(951回)入札
（3ヶ月、75,500億円、11/16発行）
*エネルギー対策借入
（6,500億円、11/20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