Central Daily Market Report

2020年11月17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17日 需給速報		2020年11月18日 需給予想		2020年11月19日 当社予想	
銀行券	400		▲ 200		▲ 1,000	
財政	▲ 2,900		▲ 2,100		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 2,500		▲ 2,300		▲ 4,000	
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			1,400	▲ 1,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入			13,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 800		
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	800					
国債補完供給	▲ 500	600		500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,800		20,800		▲ 4,000	

当座預金残高	4,801,000	4,821,800	4,817,800
準備預金残高	4,200,100		
積み終了先	4,146,400	11月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,770,500	積数	43,300
非準備預金先	600,900	1日平均	1,500
積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			3,451,500
準備預金進捗率	実績	98.75%	日数	6.67%

●2020年11月17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▲0.065～▲0.020%での調達で始まった。一巡後は▲0.03%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>

GCT/N(11/18-11/19)は、▲0.10～▲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2Y410～418、5Y136～145、10Y345～360、20Y171～174、30Y65～68、40Y10～13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から5,000億円減額の10,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+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▲0.114～▲0.110%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還額は僅かであったが、商社・小売・電機等から大口の発行が実施されたため、発行総額は2,600億円程度に膨らんだ。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/17	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	▲ 0.033				－	▲ 0.093
T/N	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.004				－	▲ 0.094
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.013	▲ 0.019				－	▲ 0.090
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.093
3W							－	▲ 0.096
1M			▲ 0.023				－	▲ 0.100
3M							▲ 0.110	▲ 0.113
6M							▲ 0.118	▲ 0.135
1Y							▲ 0.140	▲ 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)
0.020	0.000	26,014.62	107.69	104.52-54	104.47-48

日付		11/10	11/11	11/12	11/13	11/16
日銀当預残		4,829,100	4,821,900	4,859,000	4,836,900	4,802,800
準備預金残		4,238,400	4,232,700	4,259,500	4,252,600	4,211,300
マネタリーベース		6,016,800	6,008,700	6,046,100	6,023,900	5,988,900
無担O/N加重平均		▲0.034%	▲0.034%	▲0.034%	▲0.030%	▲0.038%
コール市場残高		136,511	130,486	127,437	139,629	122,555
	うち無担	116,380	110,073	107,220	119,454	102,163
	うちO/N	75,597	69,155	67,222	80,751	66,425
	うち有担	20,131	20,413	20,217	20,175	20,392

●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)
国有林野借入	－	－	859	2020/11/25	2025/11/25	4,796.0	859.00		0.0000%	25.0000%		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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2020/11/18	2020/12/2		1,404	1,404				
国庫短期証券買入	10,000	2020/11/18			31,004	10,005	0.003		0.005	9.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2020/11/18			11,438	5,004	▲0.003		▲0.001	92.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,200	2020/11/18			11,975	4,205	0.002		0.003	63.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/11/18			13,099	4,211	▲0.002		▲0.002	77.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/11/17	2020/11/18	▲ 0.350	527	527		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/17	2020/11/18	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/11/19	2020/11/27	0.340	0	0				
米ドル資金供給		2020/11/19	2021/2/12	0.330	0	0				

●2020年11月18日の予定

*10月の貿易統計
*米国10月の住宅着工件数
*ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値
*英国10月の消費者物価指数
*20年利付国債入札（12,000億円、11/19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