

Central Daily Market Report

2020年11月18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18日		2020年11月19日		2020年11月20日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,200	▲ 1,200	▲ 1,200	▲ 2,000	▲ 2,000
財政	▲ 1,000	▲ 1,400	▲ 1,400	▲ 1,400	▲ 11,000	▲ 11,000
資金過不足	▲ 1,300	▲ 2,600	▲ 2,600	▲ 2,600	▲ 13,000	▲ 13,000
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		▲ 800		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					2,000	
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			700			
国債補完供給	▲ 400	500		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	21,400		▲ 1,600		▲ 11,000	
当座預金残高	4,822,400		4,820,800		4,809,800	
準備預金残高	4,225,600					
積み終了先	4,212,400					
超過準備	4,199,400					
非準備預金先	596,800					
			11月19日以降の残り所要積立額			
			積数		17,100	
			1日平均		600	
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	99.50%	日数	10.00%		

●2020年11月18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▲0.060～▲0.015%での調達で始まった。一巡後は▲0.05%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(11/19-11/20)は、▲0.115～▲0.09%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、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、幅広い業種から発行が見られ、1,700億円程度の償還に対して、2,000億円強の発行となり、陸運・機械等からは大型発行が実施された。発行レートは銘柄間で差が見られているものの、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/11/18	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	
	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)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	0.015	▲ 0.005	25,728.14	▲ 286.48	104.17-18	103.88-89
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.087						
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.020	▲ 0.018				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.020	▲ 0.007	▲ 0.015				-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.110	▲ 0.113						
6M							▲ 0.117	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.157						
									日付	11/11	11/12	11/13	11/16	11/17
									日銀当預残	4,821,900	4,859,000	4,836,900	4,802,800	4,801,000
									準備預金残	4,232,700	4,259,500	4,252,600	4,211,300	4,200,200
									マネタリーベース	6,008,700	6,046,100	6,023,900	5,988,900	5,986,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.034%	▲ 0.034%	▲ 0.030%	▲ 0.038%	▲ 0.033%
									コール市場残高	130,486	127,437	139,629	122,555	116,214
									うち無担	110,073	107,220	119,454	102,163	96,181
									うちO/N	69,155	67,222	80,751	66,425	58,018
									うち有担	20,413	20,217	20,175	20,392	20,033

●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)
20年利付国債	174	0.40%	12,000	2020/11/19	2040/9/20	34,950.0	9,678.0	100.1500	0.3910%	17.0997%	100.2200	0.3880%	2,317.0

●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)		2020/11/18	2020/11/19	▲ 0.350	353	353		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/18	2020/11/19	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2000	2020/11/20			2,900	2,000	0.043		0.077	39.9

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第5回	2020/11/20	2022/11/18	0

●2020年11月19日の予定

*10月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(952回)入札 (1年、35,000億円、11/20発行)	*交付税特別会計借入 (11,000億円、11/30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