Central Daily Market Report

2020年11月25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25日 需給速報		2020年11月26日 需給予想		2020年11月27日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	▲ 22,100		▲ 5,600		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 22,200		▲ 7,000		▲ 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	13,600					
CP等買入		▲ 1,000		▲ 100	6,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
新型コロナ対応金融支援特別	37,400					
ＥＴＦ買入	400					
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	28,100		▲ 6,900		4,000	

当座預金残高	4,836,000	4,829,100	4,833,100
準備預金残高	4,232,400		
積み終了先	4,232,100	11月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,232,000	積数	2,300
非準備預金先	603,600	1日平均	100
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 99.93%	日数	33.33%

●2020年11月25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▲0.045～▲0.015%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、一巡後は▲0.06～▲0.05%近辺で散発的な出合いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/26-11/27)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、3M物が▲0.105%、1Y物が▲0.135%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還2,200億円に対して、発行額は、大型の発行が数件実施されたものの、3,500億円にとどまった。発行レートは、一部の銘柄で下限を探る展開となった。CP等買入オペは事前予定通り6,000億円がオファーされた。応札額が増加したこともあり、按分レート▲0.034%、平均落札レート▲0.027%と前回（按分▲0.055%・平均▲0.034%）からいずれも上昇した。

●短期金融市場関連指標

2020/11/25	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	▲ 0.075	0.030	▲ 0.030				－	▲ 0.079
T/N	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.007				－	▲ 0.081
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				－	▲ 0.085
2W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.027				－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.094
1M							－	▲ 0.099
3M							▲ 0.104	▲ 0.110
6M							▲ 0.097	▲ 0.133
1Y							▲ 0.135	▲ 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)
0.015	▲ 0.005	26,296.86	131.27	104.50-51	104.47-49

日付	11/17	11/18	11/19	11/20	11/24
日銀当預残	4,801,000	4,822,400	4,821,900	4,813,500	4,807,900
準備預金残	4,200,200	4,225,700	4,211,000	4,237,900	4,213,500
マネタリーベース	5,986,700	6,008,400	6,009,200	6,001,800	5,996,000
無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.035%	▲0.034%	▲0.033%	▲0.031%
コール市場残高	116,214	129,342	129,999	147,096	126,824
うち無担	96,181	108,290	109,162	124,507	104,410
うちO/N	58,018	69,282	66,954	80,109	65,392
うち有担	20,033	21,052	20,837	22,589	22,414

●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)
40年利付国債	13	0.50%	5,000	2020/11/26	2060/3/20	13,341.0	4,996.0	94.3000	0.6650%	21.4007%		0.0000%	
交付税特会	－	－	11,000	2020/12/3	2021/6/2	340,764.0	11,000.08		0.0000%	3.2281%		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
CP等買入	6,000	2020/11/27			13,261	6,000	▲0.034		▲0.027	55.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/11/25	2020/11/26	▲ 0.350	196	196		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/25	2020/11/26	▲ 0.350	0	0				

●2020年11月26日の予定

*9月の景気動向指数改訂状況

*New York祝日(Thanksgiving Day)

◆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