Central Daily Market Report

2020年11月27日（金）
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27日 需給速報		2020年11月30日 需給予想		2020年12月1日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 400		0	
財政	▲ 300		7,700		▲ 33,000	
資金過不足	▲ 1,300		7,300		▲ 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	25,000					
国債買入	11,000					
CP等買入	6,000	▲ 700		▲ 4,900		
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						
ＥＴＦ買入			100			
国債補完供給	▲ 300			300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	39,500		2,800		▲ 33,000	
当座預金残高	4,868,100		4,870,900		4,837,900	
準備預金残高	4,275,000					
積み終了先	4,274,700					
超過準備	4,274,700					
非準備預金先	593,100					

11月30日以降の残り所要積立額	
積数	900
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	99.97%	日数	46.67%

●2020年11月27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～▲0.015%での調達で始まった。週末要因から取り上がる先も一部見られたものの全体的には大きな変化なく、一巡後は▲0.06～▲0.03%近辺で調整の出合いが見られた。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(11/30-12/1)は、▲0.080～▲0.070%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>

本日はTB3M物（955回）の入札が実施された。WI取引において▲0.089～▲0.087%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0897%、按分落札利回▲0.0856%と、やや軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.086%出合いと、入札と同水準で推移した。この他に、1Y物が▲0.128～▲0.125%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還額約600億円に対して、数件の大型案件が実施されたことから、発行額は約2,000億円となった。発行レートは低位横ばいながらも、銘柄により水準はまちまちであった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/27	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	▲ 0.030				－	▲ 0.079
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.077
S/N							－	－
1W	▲ 0.050	▲ 0.003	▲ 0.023				－	▲ 0.084
2W			▲ 0.020				－	▲ 0.087
3W							－	▲ 0.090
1M			▲ 0.010				－	▲ 0.097
3M							▲ 0.088	▲ 0.108
6M							▲ 0.098	▲ 0.131
1Y							▲ 0.124	▲ 0.154

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	0.005	26,644.71	107.40	104.25-27	104.07-08

日付	11/19	11/20	11/24	11/25	11/26
日銀当預残	4,821,900	4,813,500	4,807,900	4,836,000	4,828,600
準備預金残	4,211,000	4,237,900	4,213,500	4,232,400	4,256,900
マネタリーベース	6,009,200	6,001,800	5,996,000	6,024,300	6,018,300
無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.033%	▲0.031%	▲0.030%	▲0.030%
コール市場残高	129,999	147,096	126,824	124,414	128,556
うち無担	109,162	124,507	104,410	102,138	106,857
うちO/N	66,954	80,109	65,392	61,220	65,459
うち有担	20,837	22,589	22,414	22,276	21,699

●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)
国庫短期証券	955	－	75,500	2020/11/30	2021/3/8	181,065.0	61,558.40	100.0230	▲0.0856%	91.5868%	100.0241	▲0.0897%	13,941.0
2年利付国債	419	0.10%	30,000	2020/12/1	2022/12/1	80,926.0	25,195.0	100.4700	▲0.1340%	30.8217%	100.4810	▲0.1390%	4,800.0

●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）		2020/11/27	2020/11/30	▲ 0.350	260	260		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/27	2020/11/30	▲ 0.350	0	0				

●2020年11月30日の予定

*10月の商業動態統計速報
*10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比＋2.1%）
*10月の住宅着工統計
*米国11月のシカゴPM景況感指数

◆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