Central Daily Market Report

2020年11月30日（月）
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30日 需給速報		2020年12月1日 需給予想		2020年12月2日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 500		▲ 1,000	
財政	5,000		▲ 32,900		▲ 98,000	
資金過不足	4,500		▲ 33,400		▲ 99,000	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,100			
CP等買入		▲ 4,900		▲ 400		
貸出支援基金（成）					1,700	▲ 5,600
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					
国債補完供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 100		▲ 27,600		▲ 104,300	

当座預金残高	4,868,000	4,840,400	4,736,100
準備預金残高	4,287,900		
積み終了先	4,287,600		
超過準備	4,287,600		
非準備預金先	580,100		

12月1日以降の残り所要積立額	
積数	600
1日平均	0

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	99.98%	日数 50.00%

●2020年11月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末要因により資金調達を控える参加者が見られたため、前営業日よりやや低い水準での取引となった。立ち上がりは都銀業態から▲0.05%、地銀・証券業態などから▲0.045～▲0.015%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.075～▲0.02%で出合いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は、1～2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(12/1-12/2)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2Y410～419、5Y136～145、10Y345～360、20Y167～173、30Y59～68、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、1Y物が▲0.138～▲0.127%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還が無く、発行総額は50億円程度と、閑散としたマーケットであった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/11/30	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	▲ 0.032				－	▲ 0.077
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.077
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.018	▲ 0.021				－	▲ 0.082
2W			▲ 0.019				－	▲ 0.085
3W			0.010				－	▲ 0.091
1M							－	▲ 0.102
3M							▲ 0.087	▲ 0.109
6M							▲ 0.098	▲ 0.131
1Y							▲ 0.131	▲ 0.155

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	0.000	26,433.62	▲ 211.09	104.08-09	104.02-04

日付	11/20	11/24	11/25	11/26	11/27
日銀当預残	4,813,500	4,807,900	4,836,000	4,828,600	4,868,100
準備預金残	4,237,900	4,213,500	4,232,400	4,256,900	4,276,100
マネタリーベース	6,001,800	5,996,000	6,024,300	6,018,300	6,058,800
無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.031%	▲0.030%	▲0.030%	▲0.030%
コール市場残高	147,096	126,824	124,414	128,556	140,869
うち無担	124,507	104,410	102,138	106,857	120,085
うちO/N	80,109	65,392	61,220	65,459	79,647
うち有担	22,589	22,414	22,276	21,699	20,784

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ｉ非価格競争入札（億円）
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債買入（残存期間1年以下）	1,500	2020/12/1			5,396	1,503	0.011		0.030	9.4
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,200	2020/12/1			8,859	4,205	0.005		0.006	44.4
国債買入（残存期間25年超）	300	2020/12/1			2,269	304	0.003		0.003	58.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/11/30	2020/12/1	▲ 0.350	112	112		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/30	2020/12/1	▲ 0.350	0	0				

●2020年12月1日の予定

*10月の完全失業率（市場予想：3.1%）
*10月の有効求人倍率（市場予想：1.03倍）
*7-9月期の法人企業統計調査季報
*米国10月の建設支出
*米国11月のISM製造業景況指数
*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値
*10年利付国債入札（26,000億円、12/2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