Central Daily Market Report

2020年11月16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16日 需給速報		2020年11月17日 需給予想		2020年11月18日 当社予想	
銀行券	800		400		0	
財政	▲ 33,000		▲ 6,100		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 32,200		▲ 5,700		▲ 1,000	
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						▲ 1,600
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 1,600		▲ 200		
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	▲ 600	300		600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 34,100		▲ 4,500		▲ 2,600	

当座預金残高	4,802,800	4,798,300	4,795,700
準備預金残高	4,211,100		
積み終了先	2,904,100		
超過準備	1,227,600		
非準備預金先	591,700		

11月17日以降の残り所要積立額	
積数	467,900
1日平均	16,100

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 86.44%	日数	3.33%

●2020年11月16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。新積み期入りしたことで、一部に様子見姿勢となる先もあり、ビッド水準に広がりがみられた。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ロール案件を中心に、ショートターム物の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(11/17-11/18)は、▲0.09～▲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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.114%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額1,600億円強に対して、発行総額は1,500億円強となった。商社・ノンバンクからはまとまった発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/16	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	0.001	▲ 0.038				－	▲ 0.084
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.084
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.020				－	▲ 0.088
2W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.018				－	▲ 0.091
3W							－	▲ 0.095
1M	▲ 0.030	▲ 0.018	▲ 0.025				－	▲ 0.100
3M							▲ 0.113	▲ 0.109
6M							▲ 0.120	▲ 0.134
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	25,906.93	521.06	104.66-68	104.44-46

日付	11/9	11/10	11/11	11/12	11/13
日銀当預残	4,842,200	4,829,100	4,821,900	4,859,000	4,836,900
準備預金残	4,231,100	4,238,400	4,232,700	4,259,500	4,252,600
マネタリーベース	6,030,400	6,016,800	6,008,700	6,046,100	6,023,900
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.034%	▲0.034%	▲0.034%	▲0.030%
コール市場残高	142,114	136,511	130,486	127,437	139,629
うち無担	121,665	116,380	110,073	107,220	119,454
うちO/N	73,727	75,597	69,155	67,222	80,751
うち有担	20,449	20,131	20,413	20,217	20,175

●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)
流動性供給	321	－	5,000	2020/11/17		16,288.0	4,985.0		▲0.0050%	14.3529%		▲0.0070%	

●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）		2020/11/16	2020/11/17	▲ 0.350	632	632		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/16	2020/11/17	▲ 0.350	0	0				

●2020年11月17日の予定

*米国9月の企業在庫
*米国10月の小売売上高
*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率
*国有林野借入
（859億円、11/25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