Central Daily Market Report

2020年11月26日（木）
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26日 需給速報		2020年11月27日 需給予想		2020年11月30日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,000		▲ 400	
財政	▲ 6,100		500		9,900	
資金過不足	▲ 7,500		▲ 500		9,500	
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		▲ 100	6,000	▲ 700		
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						
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 7,400		40,600		9,500	

当座預金残高	4,828,600	4,869,200	4,878,700
準備預金残高	4,256,800		
積み終了先	4,256,500		
超過準備	4,256,500		
非準備預金先	571,800		

11月27日以降の残り所要積立額	
積数	2,000
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 99.94%	日数	36.67%

●2020年11月26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▲0.055～▲0.015%での調達で始まり、昨日対比で横ばい圏の動きとなった。一巡後は▲0.06～▲0.025%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>

GCT/N(11/27-11/30)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、短国買入オペが前回から15,000億円増額の25,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.004%、按分落札利回り較差+0.003%と、やや弱めの結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.100%、6M物が▲0.100～▲0.099%、1Y物が▲0.133～▲0.131%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還9,000億円に対して、月末発行に該当することから大型の案件が多く実施されて総額5,500億円程度となった。発行レートは、引き続き投資家の買い意欲が旺盛で、一部の銘柄で下げ余地を探る展開となった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/26	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				－	▲ 0.078
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				－	▲ 0.085
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.021				－	▲ 0.085
2W	▲ 0.018	0.001	▲ 0.005				－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.093
1M							－	▲ 0.098
3M							▲ 0.100	▲ 0.109
6M							▲ 0.099	▲ 0.132
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)
0.020	0.005	26,537.31	240.45	104.39-41	104.32-33

日付	11/18	11/19	11/20	11/24	11/25
日銀当預残	4,822,400	4,821,900	4,813,500	4,807,900	4,836,000
準備預金残	4,225,700	4,211,000	4,237,900	4,213,500	4,232,400
マネタリーベース	6,008,400	6,009,200	6,001,800	5,996,000	6,024,300
無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.034%	▲0.033%	▲0.031%	▲0.030%
コール市場残高	129,342	129,999	147,096	126,824	124,414
うち無担	108,290	109,162	124,507	104,410	102,138
うちO/N	69,282	66,954	80,109	65,392	61,220
うち有担	21,052	20,837	22,589	22,414	22,276

●入札結果

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
国庫短期証券買入	25,000	2020/11/27			60,830	25,005	0.003		0.004	65.9
国債買入（残存期間1年超3年以下）	5,000	2020/11/27			9,004	5,005	▲0.005		▲0.004	81.6
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,200	2020/11/27			10,280	4,207	0.003		0.003	72.4
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,200	2020/11/27			5,045	1,209	0.003		0.003	72.7
国債買入（物価連動債）	300	2020/11/27			1,767	301	▲0.140		▲0.197	26.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/11/26	2020/11/27	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/26	2020/11/27	▲ 0.350	0	0				

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円・百万ドル）	貸付先数
成長基盤強化	本則第42回	2020/12/2	2024/12/2	0	1,712	21
成長基盤強化	米ドル特則第34期	2020/12/4	2021/12/3		3,239	24
成長基盤強化	米ドル特則第30期(借り換え)	2020/12/4	2021/12/3		257	18
成長基盤強化	米ドル特則第26期(借り換え)	2020/12/4	2021/12/3		725	17
成長基盤強化	米ドル特則第22期(借り換え)	2020/12/4	2021/12/3		527	17

●2020年11月27日の予定

*11月の都区部消費者物価指数(CPI)
（市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.7%）

*国庫短期証券(955回)入札（3ヶ月、75,500億円、11/30発行）
*2年利付国債入札（30,000億円、12/1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