Central Daily Market Report

2020年11月20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20日 需給速報		2020年11月24日 需給予想		2020年11月25日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		200		0	
財政	▲ 8,200		▲ 2,200		▲ 25,000	
資金過不足	▲ 9,200		▲ 2,000		▲ 25,000	
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						
CP等買入		▲ 1,400		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	2,000	▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入	700					
国債補完供給	▲ 700	300		700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 8,400		▲ 1,800		▲ 25,000	

当座預金残高	4,813,500	4,811,700	4,786,700
準備預金残高	4,237,600		
積み終了先	4,237,200		
超過準備	4,235,600		
非準備預金先	575,900		

11月24日以降の残り所要積立額	
積数	3,000
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	99.91%	日数 26.67%

●2020年11月20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▲0.050～▲0.015%での調達で始まった。連休を跨ぐ取引であることから、一部取り上がる先も見られた。一巡後は▲0.045%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目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(11/24-11/25)は、▲0.085～▲0.07%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（953回）の入札が実施された。WI取引において▲0.096%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0989%、按分落札利回▲0.0940%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.110～▲0.103%出合いと、堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.111%、1Y物が▲0.138%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額1,700億円弱に対して、発行総額1,500億円弱の償還超となった。五・十日の発行にあたるため、幅広い業態が発行を実施した。発行レートは希少銘柄が目線を切り下げる動きも見られたが、概ね横ばい圏での決着となった。

●短期金融市場関連指標

2020/11/20	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	▲ 0.033				－	▲ 0.081
T/N	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.007				－	▲ 0.081
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.021				－	▲ 0.087
2W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.025				－	▲ 0.093
3W							－	▲ 0.094
1M							－	▲ 0.100
3M							▲ 0.105	▲ 0.111
6M							▲ 0.116	▲ 0.135
1Y							▲ 0.138	▲ 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）
0.010	0.000	25,527.37	▲ 106.97	103.80-81	103.86-87

日付	11/13	11/16	11/17	11/18	11/19
日銀当預残	4,836,900	4,802,800	4,801,000	4,822,400	4,821,900
準備預金残	4,252,600	4,211,300	4,200,200	4,225,700	4,211,000
マネタリーベース	6,023,900	5,988,900	5,986,700	6,008,400	6,009,200
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.038%	▲0.033%	▲0.035%	▲0.034%
コール市場残高	139,629	122,555	116,214	129,342	129,999
うち無担	119,454	102,163	96,181	108,290	109,162
うちO/N	80,751	66,425	58,018	69,282	66,954
うち有担	20,175	20,392	20,033	21,052	20,837

●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	953	－	75,500	2020/11/24	2021/3/1	166,060.1	61,334.4	100.0250	▲0.0940%	35.0742%	100.0263	▲0.0989%	14,165.0
流動性供給	322	－	4,000	2020/11/24		14,287.0	3,985.0		▲0.0080%	14.5200%		▲0.0100%	

●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）		2020/11/20	2020/11/24	▲ 0.350	648	648		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/11/20	2020/11/24	▲ 0.350	0	0				

●2020年11月23日の予定

*勤労感謝の日

●2020年11月24日の予定

*黒田日銀総裁、 IMF・東京大学共催 バーチャル・コンファレンスにおいて講演

*米国9月の S&P/ケース・シラー住宅価格指数

*国庫短期証券（954回）入札（6ヶ月、38,000億円、11/25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