Central Daily Market Report

2020年10月1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10月1日 需給速報		2020年10月2日 需給予想		2020年10月5日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 100		1,000	
財政	▲ 30,100		▲ 70,900		▲ 31,000	
資金過不足	▲ 31,100		▲ 71,000		▲ 30,000	
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						▲ 3,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,600					
CP等買入		▲ 300		▲ 300		
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		200			
国債補完供給	▲ 300	2,400		300		
＊ドル資金供給用担保国債供給				1,600		
当預増減	▲ 23,900		▲ 69,200		▲ 33,800	

当座預金残高	4,850,700	4,781,500	4,747,700
準備預金残高	4,232,100		
積み終了先	4,232,100		
超過準備	4,232,100		
非準備預金先	618,600		

10月2日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	0

積み期間（9/16～10/15）の所要準備額	3,409,900
準備預金進捗率　実績	99.99%　日数 53.33%

●2020年10月1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・証券業態を中心に▲0.04～▲0.015%での調達で始まった。四半期末要因が剥落したことにより調達先が増加し、レート水準は前日比で上昇した。一巡後は▲0.04%近辺での出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.02%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>
GC T/N(10/2-10/3)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2Y413～416、5Y140～144、10Y340～359、20Y170～173、30Y62～67、40Y9～13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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>
CP発行市場は商社業態において大型発行が実施された。償還総額600億円程度に対して、発行総額は900億円程度と発行超となった。発行レートは概ね前日比横ばいの動きであった。

※本日は東証が売買を終日停止した。
※銘柄入替を反映した日経平均株価の参考値は23,184.93円。

●短期金融市場関連指標

2020/10/1	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.031				－	▲ 0.087
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.011				－	▲ 0.081
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.021				－	▲ 0.087
2W	▲ 0.035	0.010	▲ 0.019				－	▲ 0.093
3W			0.010				－	▲ 0.100
1M	▲ 0.045	0.480	▲ 0.021				－	▲ 0.108
3M							▲ 0.177	▲ 0.128
6M							▲ 0.159	▲ 0.144
1Y							▲ 0.159	▲ 0.164

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	0.010	23,185.12	0.00	105.45-46	105.53-54

日付	9/24	9/25	9/28	9/29	9/30
日銀当預残	4,811,300	4,874,400	4,871,800	4,879,700	4,874,600
準備預金残	4,171,100	4,229,400	4,222,600	4,228,600	4,258,000
マネタリーベース	5,996,700	6,060,400	6,057,300	6,065,000	6,060,300
無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.030%	▲0.032%	▲0.031%	▲0.061%
コール市場残高	132,275	143,771	131,894	138,589	101,311
うち無担	112,935	120,757	109,736	117,692	80,838
うちO/N	73,522	77,414	69,073	78,569	60,625
うち有担	19,340	23,014	22,158	20,897	20,473

●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)
10年利付国債	360	0.10%	26,000	2020/10/2	2030/9/20	85,601.0	21,072.0	100.7400	0.0250%	51.3823%	100.7500	0.0240%	4,905.0
交付税特会	－	－	11,000	2020/10/9	2021/4/9	262,776.0	11,000.19		0.0000%	4.1862%		0.0000%	

●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）		2020/10/1	2020/10/2	▲ 0.350	328	328		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/10/1	2020/10/2	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月2日の予定

*8月の完全失業率(市場予想：3%)
*8月の有効求人倍率(市場予想：1.05倍)
*9月実績/10月見込み財政資金対民間収支
*9月のマネタリーベース
*9月の消費動向調査
*米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫
*米国9月の雇用統計
*国庫短期証券(941回)入札
(3ヶ月、75,500億円、10/5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