

Central Daily Market Report

2020年10月2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10月2日 需給速報	2020年10月5日 需給予想	2020年10月6日 当社予想
銀行券	0	900	1,000
財政	▲ 72,300	▲ 28,500	0
資金過不足	▲ 72,300	▲ 27,600	1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,300	▲ 3,800
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		5,800	
CP等買入		▲ 300	▲ 400
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			
E T F 買入	200		
国債補完供給		300	
※ドル資金供給用担保提供		1,600	
当増減	▲ 70,500	▲ 23,700	1,000
当座預金残高	4,780,200	4,756,500	4,757,500
準備預金残高	4,195,300		
積み終了先	4,195,200		10月5日以降の残り所要積立額
超過準備	4,195,200		積数
非準備預金先	584,900		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	100.00%	日数
			63.33%

●2020年10月2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▲0.025~▲0.01%での調達が始まった。週末3日積みの取引となることから、調達ニーズがさらに強まり、レート水準は前日比で上昇した。一巡後は▲0.02%近辺の出合いが数件見られ、今週の取引を終えた。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(10/5-10/6)は、▲0.075~▲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>

本日はTB3M物(941回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.160~▲0.155%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1525%、按分落札利回▲0.1418%と、軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.150~▲0.1475%と、底堅く推移した。この他に、6M物が▲0.153~▲0.149%、1Y物が▲0.149%で出合った。

<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150億円程度に対して、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。

●短期金融市場関連指標

2020/10/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位:%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.079	0.015	▲ 0.005	23,029.90	▲ 155.22	105.55-56	105.17-19
T/N	▲ 0.023	▲ 0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.097						
1M			▲ 0.035				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.148	▲ 0.125						
6M							▲ 0.152	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.156	▲ 0.163						
									日付	9/25	9/28	9/29	9/30	10/1
									日銀当預残	4,874,400	4,871,800	4,879,700	4,874,600	4,850,700
									準備預金残	4,229,400	4,222,600	4,228,600	4,258,000	4,232,000
									マネタリーベース	6,060,400	6,057,300	6,065,000	6,060,300	6,037,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.030%	▲ 0.032%	▲ 0.031%	▲ 0.061%	▲ 0.031%
									コール市場残高	143,771	131,894	138,589	101,311	114,541
									うち無担	120,757	109,736	117,692	80,838	94,129
									うちO/N	77,414	69,073	78,569	60,625	62,586
									うち有担	23,014	22,158	20,897	20,473	20,412

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	941	-	75,500	2020/10/5	2021/1/12	186,347.2	61,629.4	100.0385	▲0.1418%	64.4389%	100.0414	▲0.1525%	13,870.0

●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
共通担保資金供給(全店) <固定金利方式>	20,000	2020/10/5	2020/10/19		2,311	2,311				
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/10/5			2,040	1,004	0.010		0.011	69.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/10/5			9,952	3,507	0.000		0.001	22.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/10/5			5,093	1,209	0.001		0.002	9.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア一分)		2020/10/2	2020/10/5	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2020/10/2	2020/10/5	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月5日の予定

*黒田日銀総裁、全国証券大会において講演
*10月の日銀当座預金増減要因見込み

*米国9月のISM非製造業景況指数

◆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録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