

# Central Daily Market Report

2020年10月6日(火)  
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6日 需給速報	2020年10月7日 需給予想	2020年10月8日 当社予想
銀行券	1,100	400	0
財政	7,500	▲ 7,900	2,000
資金過不足	8,600	▲ 7,500	2,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		10,000	
国債買入	8,500		
CP等買入		▲ 100	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			3,000
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F買入		1,100	
国債補完供給		400	
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	17,400	3,600	5,000
当座預金残高	4,771,800	4,775,400	4,780,400
準備預金残高	4,203,800		
積み終了先	4,203,700		10月7日以降の残り所要積立額
超過準備	4,203,700		積数
非準備預金先	568,000		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
			70.00%

## ●2020年10月6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～▲0.005%での調達で始まった。一巡後は▲0.035～▲0.015%近辺で調整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、目立った出合いは見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(10/7-10/8)は、▲0.080～▲0.065%程度での出合い。SCはローラー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、短国買入オペが前回と同額の1兆円でオファーされた。平均落札利回較差+0.015%、按分落札利回較差+0.015%と、弱い結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、6M物が▲0.145%、1Y物が▲0.150%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額400億円強に対して、発行総額は1,000億円強となった。前日に引き続き案件は少なかったものの、商社から大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られていない。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/6	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.073	0.030	0.010	23,433.73	121.59	105.71-72	105.64-66
T/N	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.010	▲ 0.003				-	▲ 0.079						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.145	▲ 0.121						
6M							▲ 0.145	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.163						
									日付	9/29	9/30	10/1	10/2	10/5
									日銀当預残	4,879,700	4,874,600	4,850,700	4,780,200	4,754,400
									準備預金残	4,228,600	4,258,000	4,232,000	4,189,600	4,201,200
									マネタリーベース	6,065,000	6,060,300	6,037,400	5,966,900	5,940,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.031%	▲ 0.061%	▲ 0.031%	▲ 0.022%	▲ 0.019%
									コール市場残高	138,589	101,311	114,541	125,402	109,908
									うち無担	117,692	80,838	94,129	102,935	87,549
									うちO/N	78,569	60,625	62,586	68,522	51,786
									うち有担	20,897	20,473	20,412	22,467	22,359

## ●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)
30年利付国債	68	0.60%	9,000	2020/10/7	2050/9/20	25,785.0	7,336.0	98.9000	0.6430%	36.1111%	99.0400	0.6380%	1,654.0

## ●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
国庫短期証券買入	10,000	2020/10/7			41,467	10,000	0.015		0.015	94.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/6	2020/10/7	▲ 0.350	3	3		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/6	2020/10/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/10/8	2020/10/16	0.330	330	330				
米ドル資金供給		2020/10/8	2020/12/24	0.330	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3,000	2020/10/8			5,739	3,001	▲ 0.045		▲ 0.039	76.2

## ●2020年10月7日の予定

*8月の景気動向指数速報	*米国8月の消費者信用残高	*交付税特別会計借入(11,000億円、10/16借入)
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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