

Central Daily Market Report

2020年10月7日(水)
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7日 需給速報	2020年10月8日 需給予想	2020年10月9日 当社予想
銀行券	500	0	0
財政	▲ 8,300	1,900	▲ 25,000
資金過不足	▲ 7,800	1,900	▲ 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	10,000					
国債買入			4,000			
CP等買入				▲ 200		
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			
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
E T F 買入	1,100		400			
国債補充供給	▲ 500			500		
※ドル資金供給用担保提供供給						2,200
当増減	2,800		9,600			▲ 22,800

当座預金残高	4,774,600	4,784,200	4,761,400
準備預金残高	4,207,300		
積み終了先	4,207,300		10月8日以降の残り所要積立額
超過準備	4,207,300		積数
非準備預金先	567,300		1日平均
			0
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額			3,421,200
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			73.33%

●2020年10月7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▲0.025~▲0.010%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>

GCT/N(10/8-10/9)は、▲0.085~▲0.070%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>

本日のアウトライイト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.135%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、10日発行分の前倒し発行が見られ、鉄鋼から大型発行が実施されたが、2,400億円程度の償還に対し、1,500億円弱の発行にとどまる償還超となった。発行レートは、銘柄間で差はあるものの概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/10/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買取引統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.010					-	▲ 0.071	0.035	0.005	23,422.82	▲ 10.91	105.63-65	105.86-87
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.076						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.005					-	▲ 0.079						
2W			▲ 0.015					-	▲ 0.086						
3W								-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.030					-	▲ 0.099						
3M									▲ 0.145						
6M									▲ 0.145						
1Y									▲ 0.150						

	日付	9/30	10/1	10/2	10/5	10/6
日銀当預残	4,874,600	4,850,700	4,780,200	4,754,400	4,771,800	
準備預金残	4,258,000	4,232,000	4,189,600	4,201,200	4,203,800	
マネタリーベース	6,060,300	6,037,400	5,966,900	5,940,200	5,956,600	
無担O/N加重平均	▲0.061%	▲0.031%	▲0.022%	▲0.019%	▲0.014%	
コール市場残高	101,311	114,541	125,402	109,908	108,603	
うち無担	80,838	94,129	102,935	87,549	86,106	
うちO/N	60,625	62,586	68,522	51,786	48,093	
うち有担	20,473	20,412	22,467	22,359	22,497	

●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)
交付税特会	-	-	11,000	2020/10/16	2021/4/16	323,393.0	11,000.00		0.0000%	3.4015%		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	応募総額(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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/10/8			12,261	3,504	▲0.002		▲0.001	33.3
国債買入(変動利付債)	500	2020/10/8			1,160	501	▲0.350		▲0.392	67.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/7	2020/10/8	▲ 0.350	443	443		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/7	2020/10/8	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月8日の予定

*8月の国際収支	*国庫短期証券(942回)入札(6ヶ月、38,000億円、10/12発行)	*5年利付国債入札(25,000億円、10/8発行)
*9月の景気ウォッチャー調査		

◆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ようを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