

Central Daily Market Report

2020年10月9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9日 需給速報	2020年10月12日 需給予想	2020年10月13日 当社予想
銀行券	0	800	0
財政	▲ 28,400	▲ 14,900	2,000
資金過不足	▲ 28,400	▲ 14,100	2,000
金融調節	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			
国債買入		10,000	
CP等買入		▲ 400	▲ 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			
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入	500	1,400	
国債補完供給	▲ 200		200
※ドル資金供給用担保確保供給		2,200	
当預増減	▲ 26,300	▲ 2,700	2,000
当座預金残高	4,757,500	4,754,800	4,756,800
準備預金残高	4,210,000		
積み終了先	4,210,000		10月12日以降の残り所要積立額
超過準備	4,210,000		積数
非準備預金先	547,500		1日平均
			0
			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
			86.67%

●2020年10月9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▲0.010~▲0.005%での調達で始まった。一巡後は▲0.015~▲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>

GC T/N(10/12-10/13)は、▲0.070~▲0.060%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、5Y140~145、10Y340~360、20Y170~173、30Y62~68、40Y9~13等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB3M(943回)の入札が実施された。WI取引において▲0.105~▲0.097%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0945%、按分落札利回▲0.0875%と弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.090~▲0.084% 出合いと更に軟調に推移した。この他に、6M物が▲0.118~▲0.115%、1Y物が▲0.140%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、1,000億円程の償還総額に対して、発行総額は350億円程度にとどまった。案件も少なく、閑散とした展開に終始した。

●短期金融市場関連指標

2020/10/9	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.072	0.029	▲ 0.005	23,619.69	▲ 27.38	106.02-03	105.93-94
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.012				-	▲ 0.077						
2W	▲ 0.015	0.020	▲ 0.007				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.088						
1M			0.030				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.085	▲ 0.119						
6M							▲ 0.116	▲ 0.142						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.162						
									日付	10/2	10/5	10/6	10/7	10/8
									日銀当預残	4,780,200	4,754,400	4,771,800	4,774,600	4,783,800
									準備預金残	4,189,600	4,201,200	4,203,800	4,207,300	4,218,700
									マネタリーベース	5,966,900	5,940,200	5,956,600	5,958,900	5,968,000
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.019%	▲0.014%	▲0.010%	▲0.008%
									コール市場残高	125,402	109,908	108,603	113,365	116,329
									うち無担	102,935	87,549	86,106	92,168	95,044
									うちO/N	68,522	51,786	48,093	52,855	56,351
									うち有担	22,467	22,359	22,497	21,197	21,285

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	943	-	75,500	2020/10/12	2021/1/18	162,567.0	61,780.5	100.0235	▲0.0875%	79.9574%	100.0254	▲0.0945%	13,719.0
エネルギー対策	-	-	7,000	2020/10/20	2021/10/20	168,402.0	6,999.98		0.0000%	4.1568%		0.0000%	

●オペ結果

種類	オフター額(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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/10/12			2,649	1,003	0.010		0.014	59.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/10/12			8,435	4,202	0.000		0.003	15.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/10/12			8,281	4,208	▲0.008		▲0.007	80.1
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/10/12			1,862	301	▲0.001		0.000	81.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2020/10/9	2020/10/12	▲0.350	219	219		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2020/10/9	2020/10/12	▲0.350	0	0				

●2020年10月12日の予定

*8月の機械受注統計 (市場予想:電力除く民需、前月比0.0%)	*9月の企業物価指数	*米国祝日(Columbus Day)
-------------------------------------	------------	---------------------

◆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