

# Central Daily Market Report

2020年10月14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14日		2020年10月15日		2020年10月16日		
	需給速報		需給予想		当社予想		
銀行券	300		▲ 600		▲ 1,000		
財政	▲ 500		71,200		▲ 5,000		
資金過不足	▲ 200		70,600		▲ 6,000		
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	25,000						
国債買入			12,300				
CP等買入		▲ 200	6,000	▲ 700			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)							
被災地支援					100	▲ 100	
社債等買入							
新型コロナ対応金融支援特別							
E T F買入							
国債補完供給	▲ 100	1,000		100			
※ドコモ資金供給用担保貸付供給							
当増減	25,500		88,300		▲ 6,000		
当座預金残高	4,779,800		4,868,100		4,862,100		
準備預金残高	4,233,300						
積み終了先	4,233,300				10月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,233,300				積数	0	
非準備預金先	546,500				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	96.67%			

## ●2020年10月14日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.035~▲0.01%での調達で始まった。積み最終日を直前に控え、出合いレートは昨日とほぼ同水準であった。一巡後は▲0.03%近辺で出合いが見られた。ターム物に関しては、特段出合いは見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(10/15-10/16)は、▲0.085~▲0.080%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＞

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.123~▲0.120%、1Y物が▲0.142%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額は1,600億円程度で、発行総額は300億円程度であった。発行レートは、概ねマイナス圏で、横ばいの推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/14	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	先買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.078	0.026	0.001	23,626.73	24.95	105.46-48	105.43-44
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.025	0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.084						
3W			0.030				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.020	0.013	0.008				-	▲ 0.097						
3M								▲ 0.090						
6M								▲ 0.123						
1Y								▲ 0.142						

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/10/15			10,614	4,201	0.001		0.002	64.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/10/15			8,220	3,502	▲0.002		▲0.001	42.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/10/15			14,490	4,210	▲0.003		▲0.002	43.8
国債買入(物価連動債)	300	2020/10/15			1,140	301	▲0.120		▲0.194	32.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/14	2020/10/15	▲ 0.350	74	74		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/14	2020/10/15	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/10/16	2020/10/22	0.340	80	80				
米ドル資金供給		2020/10/16	2021/1/7	0.330	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第4回	2020/10/16		90

## ●2020年10月15日の予定

*8月の第3次産業活動指数	*流動性供給入札(5,000億円、10/16発行)
*8月の石油等消費動態統計	*交付税特別会計借入(11,000億円、10/23借入)

◆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