

●資金需給

単位：億円	2020年10月15日	2020年10月16日	2020年10月19日
需給速報	需給予想	当社予想	
銀行券	▲ 700	0	0
財政	71,800	700	▲ 13,000
資金過不足	71,100	700	▲ 13,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 2,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	12,300		
CP等買入	6,000	▲ 700	▲ 300
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			▲ 200
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補充供給		100	
※ドル資金供給用担保提供			
当預増減	88,800	200	▲ 15,300
当座預金残高	4,868,600	4,868,800	4,853,500
準備預金残高	4,313,000		
積み終了先	4,313,000		10月16日以降の残り所要積立額
超過準備	4,313,000		積数
非準備預金先	555,600		1日平均
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額			3,537,500
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数

●短期金融市場関連指標

2020/10/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.081
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.090
S/N							-	-
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.087
2W	▲ 0.020	0.015	▲ 0.008				-	▲ 0.087
3W							-	▲ 0.092
1M	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.099
3M							▲ 0.090	▲ 0.115
6M							▲ 0.123	▲ 0.138
1Y							▲ 0.142	▲ 0.161

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.020	▲ 0.006	23,507.23	▲ 119.50	105.13-15	105.21-22
日付	10/8	10/9	10/12	10/13	10/14
日銀当預残	4,783,800	4,757,500	4,751,000	4,754,300	4,779,800
準備預金残	4,218,700	4,210,000	4,212,100	4,206,700	4,233,300
マネタリーベース	5,968,000	5,941,800	5,934,700	5,937,600	5,962,700
無担O/N加重平均	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.016%	▲ 0.020%	▲ 0.020%
コール市場残高	116,329	117,362	102,493	101,659	107,311
うち無担	95,044	97,051	81,742	81,831	88,045
うちO/N	56,351	51,163	44,754	46,313	52,597
うち有担	21,285	20,311	20,751	19,828	19,266

●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)
流動性供給	320	-	5,000	2020/10/16		22,030.0	4,979.0		▲ 0.0060%	4.5298%		▲ 0.0070%	
交付税特会	-	-	11,000	2020/10/23	2021/4/23	351,979.0	11,000.21		0.0000%	3.1253%		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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/15	2020/10/16	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/15	2020/10/16	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月16日の予定

*米国8月の企業在庫 *米国9月の小売売上高 *米国9月の鉱工業生産・設備稼働率 *米国10月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(944回)入札 (3ヶ月、75,500億円、10/19発行)
--	---

◆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論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