

●資金需給

単位：億円	2020年10月20日	2020年10月21日	2020年10月22日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 600	▲ 1,000
財政	▲ 17,800	▲ 12,600	1,000
資金過不足	▲ 18,100	▲ 13,200	0
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			
CP等買入		▲ 200	▲ 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			2,000
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補充供給		200	
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 18,100	▲ 13,400	2,000
当座預金残高	4,833,900	4,820,500	4,822,500
準備預金残高	4,216,200		
積み終了先	4,213,600		10月21日以降の残り所要積立額
超過準備	4,213,400		積数 7,800
非準備預金先	617,700		1日平均 300
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 99.78%	日数 16.13%	

●短期金融市場関連指標

2020/10/20	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	売買参考値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.075
T/N	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.080
S/N							-	-
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.082
2W							-	▲ 0.086
3W							-	▲ 0.090
1M	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.097
3M							▲ 0.093	▲ 0.111
6M							▲ 0.126	▲ 0.136
1Y							▲ 0.143	▲ 0.160

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	0.000	23,567.04	▲ 104.09	105.45-46	105.54-56
日付	10/13	10/14	10/15	10/16	10/19
日銀当預残	4,754,300	4,779,800	4,868,600	4,869,100	4,852,000
準備預金残	4,206,700	4,233,300	4,313,000	4,246,900	4,237,600
マネタリーベース	5,937,600	5,962,700	6,052,200	6,052,800	6,036,000
無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.014%	▲ 0.033%	▲ 0.031%
コール市場残高	101,659	107,311	104,668	126,744	120,488
うち無担	81,831	88,045	84,067	105,812	99,435
うちO/N	46,313	52,597	50,574	72,189	62,822
うち有担	19,828	19,266	20,601	20,932	21,053

●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)
20年利付国債	174	0.40%	12,000	2020/10/21	2040/9/20	37,551.0	9,728.0	100.0500	0.3970%	18.5341%	100.1000	0.3940%	2,260.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/20	2020/10/21	▲ 0.350	2	2		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/20	2020/10/21	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/10/22	2020/10/29	0.340	30	30				
米ドル資金供給		2020/10/22	2021/1/14	0.330	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/10/22			3,124	2,001	0.103		0.127	61.6

●2020年10月21日の予定

*米国ページブック *英国9月の消費者物価指数

◆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。
◆本資料は何ら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