

Central Daily Market Report

2020年10月21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21日		2020年10月22日		2020年10月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,600			0
財政	▲ 12,800		2,700			17,000
資金過不足	▲ 13,500		1,100			17,000
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			20,000			
国債買入			12,600			
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	▲ 100			100		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当預増減	▲ 13,800		35,600			17,000
当座預金残高	4,820,100		4,855,700			4,872,700
準備預金残高	4,208,400					
積み終了先	4,206,300				10月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,206,000				積数	5,400
非準備預金先	611,700				1日平均	200
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	99.85%	日数	19.35%		

●2020年10月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日に引き続き邦銀勢から強い調達姿勢が見られたため、高い水準での取引となった。立ち上がりは都銀・信託業態から▲0.03~▲0.02%、地銀・証券業態などから▲0.03~▲0.015%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲0.02%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/22-10/23)は、▲0.095~▲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2Y402~417、5Y136~145、10Y335~360、20Y167~173、30Y59~68、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、短国買入オペアが前回より5,000億円減額の20,000億円でおファーされた。平均落札利回較差+0.011%、按分落札利回較差+0.007%と、やや弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.090%、6M物が▲0.120%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、複数の業態から入札が実施されたものの、大型案件に限られたことから1,000億円程度にとどまった。償還額も概ね同額であった。発行レートは引き続きマイナス圏で、ほぼ横ばいでの推移となった。

●短期金融市場関連指標

2020/10/21	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.076	0.030	0.010	23,639.46	72.42	105.47-49	105.01-03
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.012	▲ 0.018				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.087						
3W			0.030				-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.093	▲ 0.111						
6M							▲ 0.126	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.160						
									日付	10/14	10/15	10/16	10/19	10/20
									日銀当預残	4,779,800	4,868,600	4,869,100	4,852,000	4,833,900
									準備預金残	4,233,300	4,313,000	4,246,900	4,237,600	4,216,200
									マネタリーベース	5,962,700	6,052,200	6,052,800	6,036,000	6,018,200
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.014%	▲0.033%	▲0.031%	▲0.022%
									コール市場残高	107,311	104,668	126,744	120,488	125,161
									うち無担	88,045	84,067	105,812	99,435	103,217
									うちO/N	52,597	50,574	72,189	62,822	64,859
									うち有担	19,266	20,601	20,932	21,053	21,944

●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	業分率	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
国庫短期証券買入	20,000	2020/10/22			50,852	20,002	0.007		0.011	59.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/10/22			13,035	4,201	0.005		0.005	97.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/10/22			13,815	3,509	0.003		0.003	51.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/10/22			13,330	4,210	0.003		0.004	76.0
国債買入(物価連動債)	300	2020/10/22			1,170	301	▲0.110		▲0.199	38.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/21	2020/10/22	▲0.350	102	102		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/21	2020/10/22	▲0.350	0	0				

●2020年10月22日の予定

*米国9月の中古住宅販売	*国庫短期証券(946回)入札(6ヶ月、38,000億円、10/26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