

Central Daily Market Report

2020年10月23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23日		2020年10月26日		2020年10月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900	0	0	0	0	0
財政	13,600	▲ 45,500	▲ 45,500	2,000	2,000	2,000
資金過不足	12,700	▲ 45,500	▲ 45,500	2,000	2,000	2,000
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 600				
新型コロナ対応金融支援特別	27,600					
E T F 買入			200			
国債補完供給	▲ 500	300		500		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	39,200	▲ 44,900	▲ 44,900	2,000	2,000	2,000
当座預金残高	4,894,800	4,849,900	4,849,900	4,851,900	4,851,900	4,851,900
準備預金残高	4,279,800					
積み終了先	4,279,500					
超過準備	4,279,400					
非準備預金先	615,000					
10月26日以降の残り所要積立額						
積数				2,400		
1日平均				100		
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	99.93%	日数	32.26%		

●2020年10月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因によって取り上がる動きが見られたため、昨日より高い水準での取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態等から▲0.01~▲0.008%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.07~▲0.01%近辺で散発的な出会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(10/26-10/27)は、▲0.085~▲0.075%程度での出会い。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>

本日はTB3M物(947回)の入札が実施された。WI取引において▲0.082~▲0.080%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.0793%、按分落札利回▲0.0744%と、軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.083~▲0.080%出会いと、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、償還総額100億円強に対して、発行額も同程度と閑散としていた。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/10/23	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	売買差	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.091	0.035	0.005	23,516.59	42.32	104.90-92	104.68-69
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.077						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.010	0.020	▲ 0.005				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.082	▲ 0.111						
6M							▲ 0.102	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.160						
日付		10/16	10/19	10/20	10/21	10/22								
日銀当預残		4,869,100	4,852,000	4,833,900	4,820,100	4,855,600								
準備預金残		4,246,900	4,237,600	4,216,200	4,208,400	4,244,200								
マネタリーベース		6,052,800	6,036,000	6,018,200	6,005,000	6,042,200								
無担O/N加重平均		▲0.033%	▲0.031%	▲0.022%	▲0.019%	▲0.017%								
コール市場残高		126,744	120,488	125,161	124,696	131,468								
うち無担		105,812	99,435	103,217	104,219	112,094								
うちO/N		72,189	62,822	64,859	64,266	69,691								
うち有担		20,932	21,053	21,944	20,477	19,374								

●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)
国庫短期証券	947	-	75,500	2020/10/26	2021/2/1	198,776.0	61,573.5	100.0200	▲0.0744%	54.9827%	100.0213	▲0.0793%	13,926.0
交付税特会	-	-	11,000	2020/11/5	2021/5/7	352,385.0	11,000.15		0.0000%	3.1217%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/23	2020/10/26	▲ 0.350	492	492		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/23	2020/10/26	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月26日の予定

*9月の企業向けサービス価格指数	*米国9月の新築一戸建て販売件数
*8月の景気動向指数改訂状況	

◆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