

# Central Daily Market Report

2020年10月26日(月)

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26日		2020年10月27日		2020年10月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 100			0
財政	▲ 45,600		2,700		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 45,700		2,600		▲ 2,000	
<b>金融調節</b>						
	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			9,400			
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	200		300			
国債補完供給	▲ 700	500		700		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 45,800		12,800		▲ 2,000	
当座預金残高	4,849,000		4,861,800		4,859,800	
準備預金残高	4,272,100					
積み終了先	4,271,700					
超過準備	4,271,700					
非準備預金先	576,900					
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	99.94%	日数	35.48%		

## ●2020年10月26日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.02～▲0.008%の出会い。週末要因が剥落したことで、レートは若干低下した。一巡後は▲0.03～▲0.01%で数件の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はロール案件が見られた程度であった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(10/27-10/28)は、▲0.085～▲0.075%程度での出会い。SCI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、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### ＜CP市場＞

CP市場は、償還総額200億円程度に対して、発行総額は大型の調達を実施されたことで1,300億円程度となった。発行レートは、引き続きマイナス圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/26	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.078	0.030	▲ 0.005	23,494.34	▲ 22.25	104.69-71	104.87-88
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.033	▲ 0.003	▲ 0.020				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.089						
1M			0.200				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.082	▲ 0.108						
6M							▲ 0.102	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.159						
									日付	10/19	10/20	10/21	10/22	10/23
									日銀当預残	4,852,000	4,833,900	4,820,100	4,855,600	4,894,800
									準備預金残	4,237,600	4,216,200	4,208,400	4,244,200	4,279,800
									マネタリーベース	6,036,000	6,018,200	6,005,000	6,042,200	6,082,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.031%	▲ 0.022%	▲ 0.019%	▲ 0.017%	▲ 0.012%
									コール市場残高	120,488	125,161	124,696	131,468	141,401
									うち無担	99,435	103,217	104,219	112,094	120,976
									うちO/N	62,822	64,859	64,266	69,691	69,713
									うち有担	21,053	21,944	20,477	19,374	20,425

## ●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	棄分率	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	2020/10/27			6,549	4,202	▲0.004		▲0.001	35.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/10/27			12,203	3,505	▲0.005		▲0.005	61.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/10/27			5,338	1,208	▲0.004		▲0.003	39.0
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/10/27			1,653	304	0.000		0.001	46.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/26	2020/10/27	▲ 0.350	679	679		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/26	2020/10/27	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年10月27日の予定

*米国8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(30,000億円、11/2発行)
*米国9月の耐久財新規受注	
*米国10月のCB消費者信頼感指数	

◆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