

# Central Daily Market Report

2020年10月27日(火)

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27日		2020年10月28日		2020年10月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 400		▲ 1,000	
財政	5,400		1,900		2,000	
資金過不足	5,300		1,500		1,000	
<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			25,000			
国債買入	9,400					
CP等買入		▲ 200		▲ 200	6,000	
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	300		200			
国債補完供給	▲ 200	700		200		
米ドル資金供給用担保確保供給						
<b>当増減</b>	<b>15,300</b>		<b>26,700</b>		<b>7,000</b>	
当座預金残高	4,864,300		4,891,000		4,898,000	
準備預金残高	4,273,900					
積み終了先	4,273,500				10月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,273,500				積数	1,700
非準備預金先	590,400				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	99.95%	日数	38.71%		

## ●2020年10月27日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、全体的に資金調達意欲が強い中で、一部レート目線を切り下げ動きもみられた。立ち上がりは国内勢を中心に▲0.03~▲0.008%の出会い。一巡後は▲0.03~▲0.015%の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は引き続きロール案件が見られた程度であった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/28-10/29)は、▲0.095~▲0.08%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5,000億円増額の25,000億円度でオファーされた。平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.000%と、しっかりした結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.088~▲0.085%、6M物が▲0.103~▲0.102%、1Y物が▲0.133~▲0.130%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,200億円程度に対して、発行総額は650億円程度と償還超であった。小型案件を中心とする落ち着いたマーケットであった。発行レートはマイナス圏で、引き続き横ばいで推移した。本日はCP等買入オペアが6,000億円オファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.025%・按分レート▲0.033%と、前回(平均▲0.021%・按分▲0.038%)比で平均レートは低下し、按分レートは上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/27	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.078	0.025	▲ 0.005	23,485.80	▲ 8.54	104.82-84	104.83-84
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.007	▲ 0.021				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.028	0.020	0.001				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.088	▲ 0.111						
6M							▲ 0.103	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.138	▲ 0.158						
									日付	10/20	10/21	10/22	10/23	10/26
									日銀当預残	4,833,900	4,820,100	4,855,600	4,894,800	4,849,000
									準備預金残	4,216,200	4,208,400	4,244,200	4,279,800	4,268,100
									マネタリーベース	6,018,200	6,005,000	6,042,200	6,082,300	6,036,600
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.012%	▲0.016%
									コール市場残高	125,161	124,696	131,468	141,401	130,495
									うち無担	103,217	104,219	112,094	120,976	110,951
									うちO/N	64,859	64,266	69,691	69,713	60,038
									うち有担	21,944	20,477	19,374	20,425	19,544

## ●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)
2年利付国債	418	0.10%	30,000	2020/11/2	2022/11/1	97,441.0	24,458.00	100.4550	▲0.1270%	73.1880%	100.4610	▲0.1300%	5,535.0

## ●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
国庫短期証券買入	25,000	2020/10/28			52,007	25,004	0.000		0.006	11.6
CP等買入	6,000	2020/10/29			10,604	5,990	▲0.033		▲0.025	4.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/27	2020/10/28	▲ 0.350	217	217		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/27	2020/10/28	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/10/29	2020/11/6	0.330	0	0				
米ドル資金供給		2020/10/29	2021/1/22	0.330	0	0				

## ●2020年10月28日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、29日まで)

\*交付税特別会計借入(11,000億円、11/9借入)

◆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