

Central Daily Market Report

2020年10月28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28日		2020年10月29日		2020年10月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 800		▲ 500	
財政	2,400		700		▲ 1,900	
資金過不足	1,900		▲ 100		▲ 2,400	
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	25,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 200	6,000	▲ 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					
国債補完供給	▲ 300	200		300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	26,800		6,000		▲ 2,400	
当座預金残高	4,891,100		4,897,100		4,894,700	
準備預金残高	4,288,300					
積み終了先	4,288,000				10月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,288,000				積数	1,300
非準備預金先	602,800				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	99.96%	日数	41.94%		

●2020年10月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、調達意欲が全般的には強いものの、一部の先で調達水準を切り下げる動きが見られ、朝方は国内勢を中心に▲0.04~▲0.01%の出会い。一巡後は▲0.03%台の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はロール案件を中心に出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/29-10/30)は、▲0.095~▲0.085%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、10Y340~360、20Y171~174、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、6M物が▲0.103%、1Y物が▲0.136~▲0.134%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10,000億円程度に対して、発行総額は7,000億円程度と大きく償還超であった。発行日が月末となったことで、複数の業態において大型発行案件が見られ、活況なマーケットであった。発行レートはマイナス圏で、引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/10/28	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.024				-	▲ 0.084	0.020	▲ 0.005	23,418.51	▲ 67.29	104.54-55	104.21-22
T/N	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.032				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.090	▲ 0.112						
6M							▲ 0.103	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.158						
									日付	10/21	10/22	10/23	10/26	10/27
									日銀当預残	4,820,100	4,855,600	4,894,800	4,849,000	4,864,300
									準備預金残	4,208,400	4,244,200	4,279,800	4,268,100	4,273,900
									マネタリーベース	6,005,000	6,042,200	6,082,300	6,036,600	6,051,900
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.017%	▲0.012%	▲0.016%	▲0.019%
									コール市場残高	124,696	131,468	141,401	130,495	120,275
									うち無担	104,219	112,094	120,976	110,951	98,993
									うちO/N	64,266	69,691	69,713	60,038	55,980
									うち有担	20,477	19,374	20,425	19,544	21,282

●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)
交付税特会	-	-	11,000	2020/11/9	2021/5/11	370,643.0	11,000.62		0.0000%	2.9680%		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)		2020/10/28	2020/10/29	▲ 0.350	334	334		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/28	2020/10/29	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月29日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*ECB定例理事会(金融政策発表)
*黒田日銀総裁定例会見	*米国7-9月期のGDP速報値
*経済・物価情勢の展望	
*9月の商業動態統計速報	
*10月の消費動向調査	

◆本資料は信頼できるとさ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