Central Daily Market Report

2020年10月29日(木)

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29日 需給速報		2020年10月30日 需給予想		2020年11月2日 当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 500		0	
財政	300		▲ 200		▲ 29,000	
資金過不足	▲ 600		▲ 700		▲ 29,000	
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						▲ 2,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入	6,000	▲ 200		▲ 4,700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	5,300		▲ 4,600		▲ 31,800	

当座預金残高	4,896,400	4,891,800	4,860,000
準備預金残高	4,279,200		
積み終了先	4,278,900	10月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,278,900	積数	1,000
非準備預金先	617,200	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 99.97%	日数	45.16%

●2020年10月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き積極的な調達姿勢が見られる中、朝方は▲0.04～▲0.015%の出合い。一巡後は▲0.03%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、ロール案件を中心にショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/30-11/2)は、▲0.10～▲0.085%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、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、特段の出合いは見られなかった。

<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300億円程度に対して、発行総額は1,800億円程度と発行超であった。機械・石油業態において大型発行が見られ、月初の発行としては比較的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。

●2020年10月30日の予定

*9月の完全失業率(市場予想：3.1%) *9月の有効求人倍率(市場予想：1.04倍)
*10月の都区部消費者物価指数(市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.5%)
*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比＋3.2%)
*9月の住宅着工統計

*米国9月の個人所得・消費支出　*米国10月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏7-9月期のGDP1次速報　*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値
*国庫短期証券(948回)入札（3ヶ月、75,500億円、11/2発行）

●短期金融市場関連指標

2020/10/29	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.026				－	▲ 0.091
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.015				－	▲ 0.100
S/N			▲ 0.025				－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.013	▲ 0.023				－	▲ 0.094
2W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.007				－	▲ 0.093
3W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.009				－	▲ 0.093
1M	▲ 0.020	0.040	0.000				－	▲ 0.100
3M							▲ 0.090	▲ 0.111
6M							▲ 0.103	▲ 0.134
1Y							▲ 0.137	▲ 0.158

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.025	0.005	23,331.94	▲ 86.57	104.31-32	104.28-29

日付	10/22	10/23	10/26	10/27	10/28
日銀当預残	4,855,600	4,894,800	4,849,000	4,864,300	4,891,100
準備預金残	4,244,200	4,279,800	4,268,100	4,273,900	4,288,600
マネタリーベース	6,042,200	6,082,300	6,036,600	6,051,900	6,079,200
無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.012%	▲0.016%	▲0.019%	▲0.024%
コール市場残高	131,468	141,401	130,495	120,275	125,701
うち無担	112,094	120,976	110,951	98,993	107,088
うちO/N	69,691	69,713	60,038	55,980	62,575
うち有担	19,374	20,425	19,544	21,282	18,613

●入札結果

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/29	2020/10/30	▲ 0.350	228	228		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/29	2020/10/30	▲ 0.350	0	0				

●日銀政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。
(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)
短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとする。
(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する。)
(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)
①ETFおよびJ-REITについて、当面は、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、積極的な買入れを行う。
(ＥＴＦおよびＪ－ＲＥＩＴの原則的な買入れ方針としては、引き続き、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行い、その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。)
②CP等、社債等については、それぞれ約2兆円、約3兆円の残高を維持する。これに加え、2021年3月末までの間、それぞれ7.5兆円の残高を上限に、追加の買入れを行う。

◆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。
◆本資料は何ら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論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