

# Central Daily Market Report

2020年10月30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30日		2020年11月2日		2020年11月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 300		1,000	
財政	1,200		▲ 33,400		▲ 8,000	
資金過不足	700		▲ 33,700		▲ 7,000	
<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			1,600	▲ 2,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,100			
CP等買入		▲ 4,700		▲ 300		
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						
E T F 買入	700		700			
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	▲ 3,200		▲ 21,400		▲ 7,000	
当座預金残高	4,893,200		4,871,800		4,864,800	
準備預金残高	4,273,600					
積み終了先	4,273,600		11月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,273,300		積数	300		
非準備預金先	619,600		1日平均	0		
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	99.99%	日数	54.84%		

## ●2020年10月30日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末を跨ぐ取引であったものの、調達意欲は旺盛であった。朝方は国内勢より▲0.04~▲0.01%の出合い。一巡後はレート低下し、▲0.05~▲0.035%の出合いが数件見られ、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複数見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(11/2-11/4)は、▲0.09~▲0.08%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、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100億円程度に対して、発行総額は500億円程度と若干の発行超となった。一部の石油業態において大型発行が見られたものの、案件は少なく閑散としたマーケットであった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/30	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.093	0.035	0.010	22,977.13	▲ 354.81	104.55-57	104.35-36
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.025				-	▲ 0.090						
2W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.092						
1M	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.034				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.090	▲ 0.112						
6M							▲ 0.104	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.137	▲ 0.158						
									日付	10/23	10/26	10/27	10/28	10/29
									日銀当預残	4,894,800	4,849,000	4,864,300	4,891,100	4,896,400
									準備預金残	4,279,800	4,268,100	4,273,900	4,288,600	4,279,400
									マネタリーベース	6,082,300	6,036,600	6,051,900	6,079,200	6,085,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.016%	▲ 0.019%	▲ 0.024%	▲ 0.026%
									コール市場残高	141,401	130,495	120,275	125,701	127,836
									うち無担	120,976	110,951	98,993	107,088	108,529
									うちO/N	69,713	60,038	55,980	62,575	62,516
									うち有担	20,425	19,544	21,282	18,613	19,307

## ●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	948	-	75,500	2020/11/2	2021/2/8	199,231.7	61,678.9	100.0215	▲0.0800%	33.9886%	100.0227	▲0.0845%	13,820.0

## ●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)	発札総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均発札レート・利回差・価格差	抜付比率
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2020/11/2	2020/11/18		1,601	1,601				
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/11/2			2,122	1,004	0.007		0.017	77.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/11/2			11,551	4,204	0.005		0.006	49.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/11/2			11,323	3,509	0.007		0.008	37.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/11/2			11,206	4,210	0.007		0.007	97.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/30	2020/11/2	▲ 0.350	6	6		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/30	2020/11/2	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年11月2日の予定

- \*米国9月の建設支出
- \*米国10月のISM製造業景況指数

◆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