

# Central Daily Market Report

2020年10月5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5日 需給速報	2020年10月6日 需給予想	2020年10月7日 当社予想
銀行券	900	1,000	0
財政	▲ 30,200	7,300	▲ 5,000
資金過不足	▲ 29,300	8,300	▲ 5,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	2,300	▲ 3,800	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	5,800	8,500	
CP等買入		▲ 400	▲ 100
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			
国債補完供給	▲ 400		400
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 25,800	17,100	▲ 5,000
当座預金残高	4,754,400	4,771,500	4,766,500
準備預金残高	4,201,200		
積み終了先	4,201,100		10月6日以降の残り所要積立額
超過準備	4,201,100		積数
非準備預金先	553,200		1日平均
			0
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額			3,409,900
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			66.67%

## ●2020年10月5日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態を中心に▲0.030~▲0.010%での調達で始まった。一巡後は▲0.020~▲0.015%近辺の出会いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.02%近辺の出会いが見られた。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(10/6-10/7)は、▲0.075~▲0.065%程度での出会い。SCはローラー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2Y413~416、5Y140~144、10Y340~359、20Y170~173、30Y62~67、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、3M物が▲0.147~▲0.145%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額500億円強に対して、発行総額は1,000億円強となった。案件は少なかったが、商社から大ロットの発行が見られたため、全体の発行総額が押し上げられた。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/5	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.070	0.020	0.005	23,312.14	282.24	105.51-53	105.60-61
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.076						
2W							-	▲ 0.082						
3W			0.020				-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.098						
3M			0.080				▲ 0.145	▲ 0.123						
6M							▲ 0.150	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.156	▲ 0.163						
									日付	9/28	9/29	9/30	10/1	10/2
									日銀当預残	4,871,800	4,879,700	4,874,600	4,850,700	4,780,200
									準備預金残	4,222,600	4,228,600	4,258,000	4,232,000	4,189,600
									マネタリーベース	6,057,300	6,065,000	6,060,300	6,037,400	5,966,900
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.031%	▲0.061%	▲0.031%	▲0.022%
									コール市場残高	131,894	138,589	101,311	114,541	125,402
									うち無担	109,736	117,692	80,838	94,129	102,935
									うちO/N	69,073	78,569	60,625	62,586	68,522
									うち有担	22,158	20,897	20,473	20,412	22,467

## ●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	案分率	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	2020/10/6			8,301	4,206	0.000		0.003	19.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/10/6			9,888	4,212	0.006		0.008	13.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/5	2020/10/6	▲ 0.350	327	327		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/5	2020/10/6	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年10月6日の予定

\*米国8月の貿易収支

\*30年利付国債入札  
(9,000億円、10/7発行)

◆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