

# Central Daily Market Report

2020年10月12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12日		2020年10月13日		2020年10月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		500		0	
財政	▲ 18,400		400		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 17,800		900		▲ 5,000	
<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						
国債買入	10,000					
CP等買入		▲ 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				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	1,400					
国債補完供給	▲ 100	200		100		
<small>*ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当増減	▲ 6,500		900		▲ 5,000	
当座預金残高	4,751,000		4,751,900		4,746,900	
準備預金残高	4,212,100					
積み終了先	4,212,100		10月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,212,100		積数		0	
非準備預金先	538,900		1日平均		0	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,421,200	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	90.00%		

## ●2020年10月12日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.03~▲0.005%での調達で始まった。積みの最終週で引き続き調達ニーズは強かったものの、週末要因の剥落等から出合いレートは若干低下した。一巡後は▲0.04~▲0.01%で推移した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(10/13-10/14)は、▲0.070~▲0.060%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2Y413~416、5Y140~145、10Y340~360、20Y170~173、30Y62~68、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、3M物が▲0.090%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還は少額で、発行総額は1,000億円程度であった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/12	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.064	0.025	▲ 0.004	23,558.69	▲ 61.00	105.62-64	105.55-56
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.077						
2W							-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.090	▲ 0.115						
6M							▲ 0.116	▲ 0.138						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.162						
									日付	10/5	10/6	10/7	10/8	10/9
									日銀当預残	4,754,400	4,771,800	4,774,600	4,783,800	4,757,500
									準備預金残	4,201,200	4,203,800	4,207,300	4,218,700	4,210,000
									マネタリーベース	5,940,200	5,956,600	5,958,900	5,968,000	5,941,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.014%	▲ 0.010%	▲ 0.008%	▲ 0.008%
									コール市場残高	109,908	108,603	113,365	116,329	117,362
									うち無担	87,549	86,106	92,168	95,044	97,051
									うちO/N	51,786	48,093	52,855	56,351	51,163
									うち有担	22,359	22,497	21,197	21,285	20,311

## ●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	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/12	2020/10/13	▲ 0.350	83	83		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/12	2020/10/13	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年10月13日の予定

*9月のマネーストック	*米国9月の財政収支 *米国9月の消費者物価指数	*流動性供給入札 (5,000億円、10/14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