

# Central Daily Market Report

2020年10月13日(火)

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13日		2020年10月14日		2020年10月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		400		0	
財政	3,900		▲1,400		72,000	
資金過不足	4,300		▲1,000		72,000	
<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			25,000			
国債買入						
CP等買入				▲200	6,000	
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						
国債補完供給	▲1,000	100		1,000		
<small>※ドル資金供給用担保提供</small>						
当預増減	3,300		24,800		78,000	
当座預金残高	4,754,300		4,779,100		4,857,100	
準備預金残高	4,206,700					
積み終了先	4,206,700				10月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,206,700				積数	0
非準備預金先	547,600				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	93.33%		

## ●2020年10月13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~▲0.01%での調達で始まった。引き続き高水準であったものの、積み最終日を前にしてある程度の目途が立ったのか、昨日より出合いレートは若干低下した。一巡後は▲0.04~▲0.015%で調整の出合いが散見された。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(10/14-10/15)は、▲0.085~▲0.075%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、短国買入オベが前回より15,000億円増額の25,000億円度でオファーされた。平均落札利回較差+0.018%、按分落札利回較差+0.014%と、最近の需給の悪さを反映して、弱い結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.090~▲0.088%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は15日発行にあたったことで、直近では最も発行が膨らみ、償還総額は2,700億円程度に対して発行総額は3,700億円程度となった。発行レートは、複数の稀少銘柄の発行があったため、マイナス圏で強いビッドが入った。本日はCP等買入オベが、6,000億円度でオファーされた。平均落札レート▲0.021%、按分レート▲0.038%と、前回(平均▲0.027%・按分▲0.034%)比で平均は上昇し、按分は低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/10/13	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	▲0.070	0.001	▲0.020				-	▲0.069	0.025	0.000	23,601.78	43.09	105.34-35	105.47-49
T/N			▲0.001				-	▲0.082						
S/N							-	-						
1W							-	▲0.079						
2W							-	▲0.084						
3W							-	▲0.091						
1M			▲0.020				-	▲0.097						
3M							▲0.090	▲0.113						
6M							▲0.116	▲0.140						
1Y							▲0.149	▲0.162						
									日付	10/6	10/7	10/8	10/9	10/12
									日銀当預残	4,771,800	4,774,600	4,783,800	4,757,500	4,751,000
									準備預金残	4,203,800	4,207,300	4,218,700	4,210,000	4,212,100
									マネタリーベース	5,956,600	5,958,900	5,968,000	5,941,800	5,934,700
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.016%
									コール市場残高	108,603	113,365	116,329	117,362	102,493
									うち無担	86,106	92,168	95,044	97,051	81,742
									うちO/N	48,093	52,855	56,351	51,163	44,754
									うち有担	22,497	21,197	21,285	20,311	20,751

## ●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)
流動性供給	319	-	5,000	2020/10/14		11,614.0	4,984.0		0.0000%	93.5747%		▲0.0020%	

## ●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
国庫短期証券買入	25,000	2020/10/14			70,228	25,001	0.014		0.018	98.5
CP等買入	6,000	2020/10/15			9,384	5,999	▲0.038		▲0.021	35.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/13	2020/10/14	▲0.350	681	681		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/13	2020/10/14	▲0.350	200	200		▲0.350	▲0.350	

## ●2020年10月14日の予定

\*米国9月の生産者物価指数

◆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