

Central Daily Market Report

2020年10月15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15日		2020年10月16日		2020年10月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		0		0	
財政	71,800		700		▲ 13,000	
資金過不足	71,100		700		▲ 13,000	
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						▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,300					
CP等買入	6,000	▲ 700		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			100	▲ 100		
社債等買入				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補充供給		100				
※ドル資金供給用担保資産供給						
当預増減	88,800		200		▲ 15,300	
当座預金残高	4,868,600		4,868,800		4,853,500	
準備預金残高	4,313,000					
積み終了先	4,313,000				10月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,313,000				積数	3,537,500
非準備預金先	555,600				1日平均	114,100
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	0.00%	日数	0.00%		

●2020年10月15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▲0.015~▲0.005%での調達で始まった。積み最終日による調整から、調達意欲は強くレートは高止まった。一巡後はオファー案件が少なく▲0.02%近辺で数件の出合いが見られた程度で今積み期の取引を終えた。ターム物は来積み期スタートのショートターム物で、引き合いが複数見られた。

＜レポ市場＞

GCT/N(10/16-10/19)は、▲0.095~▲0.080%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、特段の出合いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は鉄鋼・商社から大型発行があり、償還総額は550億円程度に対し発行総額は2,400億円程度。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

2020/10/15	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.081	0.020	▲ 0.006	23,507.23	▲ 119.50	105.13-15	105.21-22
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.020	0.015	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.092						
1M	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.090	▲ 0.115						
6M							▲ 0.123	▲ 0.138						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.161						
									日付	10/8	10/9	10/12	10/13	10/14
									日銀当預残	4,783,800	4,757,500	4,751,000	4,754,300	4,779,800
									準備預金残	4,218,700	4,210,000	4,212,100	4,206,700	4,233,300
									マネタリーベース	5,968,000	5,941,800	5,934,700	5,937,600	5,962,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.016%	▲ 0.020%	▲ 0.020%
									コール市場残高	116,329	117,362	102,493	101,659	107,311
									うち無担	95,044	97,051	81,742	81,831	88,045
									うちO/N	56,351	51,163	44,754	46,313	52,597
									うち有担	21,285	20,311	20,751	19,828	19,266

●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	320	-	5,000	2020/10/16		22,030.0	4,979.0		▲ 0.0060%	4.5298%		▲ 0.0070%	
交付税特会	-	-	11,000	2020/10/23	2021/4/23	351,979.0	11,000.21		0.0000%	3.1253%		0.0000%	

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/15	2020/10/16	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/15	2020/10/16	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月16日の予定

*米国8月の企業在庫	*国庫短期証券(944回)入札
*米国9月の小売売上高	(3ヶ月、75,500億円、10/19発行)
*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率	
*米国10月のミンガン大消費者信頼感指数速報	
*ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値	

◆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