Central Daily Market Report

2020年10月22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22日 需給速報		2020年10月23日 需給予想		2020年10月26日 当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 800		1,000	
財政	2,900		14,000		▲ 39,000	
資金過不足	1,300		13,200		▲ 38,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	20,000					
国債買入	12,600					
CP等買入		▲ 200		▲ 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	2,000			▲ 600		
新型コロナ対応金融支援特別			27,600			
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	35,500		40,200		▲ 38,000	

当座預金残高	4,855,600	4,895,800	4,857,800
準備預金残高	4,244,200		
積み終了先	4,243,700		
超過準備	4,242,400		
非準備預金先	611,400		

10月23日以降の残り所要積立額	
積数	3,600
1日平均	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 99.90%	日数 22.58%

●2020年10月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日に引き続き邦銀勢から強い調達姿勢が見られたため、高い水準での取引となった。立ち上がりは都銀・信託業態から▲0.02～▲0.015%、地銀・証券業態などから▲0.02～▲0.01%の水準で調達が見られた。一巡後は▲0.07～▲0.015%近辺で散発的な出合いが見られた程度で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散見された。

<レポ市場>

GC T/N(10/23-10/26)は、▲0.100～▲0.085%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、10Y335～360、20Y167～173、30Y59～68、40Y9～13等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB6M物（946回）の入札が実施された。WI取引において▲0.110～▲0.106%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1002%、按分落札利回▲0.0982%と軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.100～▲0.099%出合いと、入札と同水準で推移した。

<CP市場>

CP発行市場は閑散としており、償還総額300億円程度に対し、発行総額は400億円程度であった。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

2020/10/22	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.017				－	▲ 0.090
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.012				－	▲ 0.091
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.022				－	▲ 0.087
2W			0.020				－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.091
1M	▲ 0.036	▲ 0.030	▲ 0.032				－	▲ 0.097
3M							▲ 0.093	▲ 0.111
6M							▲ 0.100	▲ 0.136
1Y							▲ 0.142	▲ 0.160

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.030	0.000	23,474.27	▲ 165.19	104.67-68	104.54-55

日付	10/15	10/16	10/19	10/20	10/21
日銀当預残	4,868,600	4,869,100	4,852,000	4,833,900	4,820,100
準備預金残	4,313,000	4,246,900	4,237,600	4,216,200	4,208,400
マネタリーベース	6,052,200	6,052,800	6,036,000	6,018,200	6,005,000
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.033%	▲0.031%	▲0.022%	▲0.019%
コール市場残高	104,668	126,744	120,488	125,161	124,696
うち無担	84,067	105,812	99,435	103,217	104,219
うちO/N	50,574	72,189	62,822	64,859	64,266
うち有担	20,601	20,932	21,053	21,944	20,477

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	946	－	38,000	2020/10/26	2021/4/26	113,429.0	31,320.1	100.0490	**▲0.0982%**	**89.3911%**	100.0500	**▲0.1002%**	6,679.0

●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）	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）		2020/10/22	2020/10/23	▲ 0.350	283	283		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/10/22	2020/10/23	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）	（参考）2020/10/23時点の貸出残高（億円）
新型コロナ対応金融支援特別	2020/10/23	2021/4/23	0	27,560	477,580

●2020年10月23日の予定

*9月の全国消費者物価指数（CPI）（市場予想：前年同月比（除く生鮮）▲0.4%）
*月例経済報告
*国庫短期証券(947回)入札
（3ヶ月、75,500億円、10/26発行）
*交付税特別会計借入
（11,000億円、11/5借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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