

Central Daily Market Report

2020年10月16日(金)

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16日		2020年10月19日		2020年10月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 200		0	
財政	1,100		▲ 14,400		▲ 21,000	
資金過不足	1,100		▲ 14,600		▲ 21,000	
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			2,800	▲ 2,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 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			100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	500		▲ 14,300		▲ 21,000	
当座預金残高	4,869,100		4,854,800		4,833,800	
準備預金残高	4,246,900					
積み終了先	4,229,600		10月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,073,500		積数		17,100	
非準備預金先	622,200		1日平均		600	
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	99.52%	日数	9.68%		

●2020年10月16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▲0.05~▲0.015%での調達で始まった。新しい積み期間に入り、業態ごとに調達意欲の差が見られた。地銀業態の調達意欲は強く、一部では取り上がる動きも見られた。一巡後は▲0.07~▲0.05%台の水準で推移した。ターム物は月内エンドのショートターム物を中心に、出合いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/N(10/19-10/20)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>

本日はTB3M物(944回)の入札が実施された。WI取引において▲0.090~▲0.085%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.0834%、按分落札利回▲0.0781%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、▲0.089~▲0.083%出合いと底堅く推移した。この他に、6M物が▲0.124%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は20日発行にあたったものの、小玉の発行が中心で、償還総額は150億円程度に対し発行総額は600億円程度にとどまった。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

2020/10/16	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.083	0.020	0.000	23,410.63	▲ 96.60	105.36-37	105.30-31
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.023				-	▲ 0.086						
3W			0.030				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.035	0.200	▲ 0.013				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.088	▲ 0.113						
6M							▲ 0.124	▲ 0.138						
1Y							▲ 0.142	▲ 0.161						
									日付	10/9	10/12	10/13	10/14	10/15
									日銀当預残	4,757,500	4,751,000	4,754,300	4,779,800	4,868,600
									準備預金残	4,210,000	4,212,100	4,206,700	4,233,300	4,313,000
									マネタリーベース	5,941,800	5,934,700	5,937,600	5,962,700	6,052,200
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.016%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.014%
									コール市場残高	117,362	102,493	101,659	107,311	104,668
									うち無担	97,051	81,742	81,831	88,045	84,067
									うちO/N	51,163	44,754	46,313	52,597	50,574
									うち有担	20,311	20,751	19,828	19,266	20,601

●入札結果

名称	回数	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)
国庫短期証券	944	-	75,500	2020/10/19	2021/1/25	198,812.7	61,563.2	100.0210	▲0.0781%	26.7333%	100.0224	▲0.0834%	13,936.0

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2020/10/19	2020/11/2		2,801	2,801				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/10/16	2020/10/19	▲ 0.350	140	140		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/10/16	2020/10/19	▲ 0.350	0	0				

●2020年10月19日の予定

*9月の貿易統計	*国庫短期証券(945回)入札 (1年、35,000億円、10/20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