

Central Daily Market Report

2020年9月2日(水)

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9月2日		2020年9月3日		2020年9月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		100			0
財政	▲ 43,700		▲ 8,000		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 43,800		▲ 7,900		▲ 7,000	
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			9,100			
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)	1,800	▲ 3,000				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			300			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保債供給						1,000
当増減	▲ 25,300		1,100		▲ 6,000	
当座預金残高	4,593,600		4,594,700		4,588,700	
準備預金残高	3,999,500					
積み終了先	3,999,500		9月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,999,500		積数	500		
非準備預金先	594,100		1日平均	0		
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,499,200	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	58.06%		

●2020年9月2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・証券業態を中心に▲0.08～▲0.03%の出会いとなった。一部地銀より取り上がる先も見られ、▲0.05～▲0.045%でまとまった出会いが見られた後は、▲0.075～▲0.060%で調整の出会いとなった。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GCT/N(9/3-9/4)は、▲0.12～▲0.08%程度での出会い。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2Y402~415、5Y136~144、10Y335~359、20Y167~173、30Y59~67、40Y9~13等にビッグの出入りがあった。

＜短国市場＞

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.130～▲0.127%、1Y物が▲0.144%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は、償還総額は550億円程度に対し、発行総額は450億円程度であった。発行レートは概ねマイナス圏となっており、ほぼ横ばいの動きであった。

●短期金融市場関連指標

2020/9/2	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.086	0.040	0.000	23,247.15	109.08	105.89-90	106.06-07
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.028	▲ 0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.088						
1M			0.010				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.124	▲ 0.097						
6M							▲ 0.130	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.163						
									日付	8/26	8/27	8/28	8/31	9/1
									日銀当預残	4,476,900	4,635,700	4,648,400	4,642,200	4,618,900
									準備預金残	3,890,700	4,029,900	4,022,600	4,020,300	4,021,900
									マネタリーベース	5,662,400	5,822,000	5,835,100	5,828,600	5,804,700
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.057%	▲0.052%
									コール市場残高	111,542	112,035	110,763	112,916	112,419
									うち無担	92,953	92,894	91,731	91,177	91,382
									うちO/N	59,475	58,761	57,798	59,004	60,209
									うち有担	18,589	19,141	19,032	21,739	21,037

●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	案分率	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/9/3			13,284	4,205	0.001		0.002	51.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/9/3			8,915	3,507	0.000		0.001	47.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/9/3			4,218	1,212	0.002		0.003	17.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/2	2020/9/3	▲ 0.350	132	132		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/2	2020/9/3	▲ 0.350	0	0				

●2020年9月3日の予定

*9月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国7月の貿易収支 *米国8月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札(9,000億円、9/4発行) *交付税特別会計借入(10,000億円、9/11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