

Central Daily Market Report

2020年9月3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9月3日		2020年9月4日		2020年9月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		300		1,000	
財政	▲ 7,600		▲ 5,700		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 7,500		▲ 5,400		▲ 5,000	
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						▲ 2,800
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,100					
CP等買入		▲ 400		▲ 600	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		▲ 100		
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
E T F買入	300					
国債補完供給	▲ 200	100		200		
※ドル資金供給用担保提供供給				1,000		
当増減	1,300		▲ 4,900		▲ 1,800	
当座預金残高	4,594,900		4,590,000		4,588,200	
準備預金残高	3,973,800					
積み終了先	3,973,700					
超過準備	3,973,700					
非準備預金先	621,100					
			9月4日以降の残り所要積立額			
			積数		500	
			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		61.29%	

●2020年9月3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。▲0.055~▲0.045%のレンジでまとまった出会いが見られた後は、▲0.08~▲0.045%で調整の出会いとなった。ターム物に関しては月内エンドのショートターム物で出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(9/4~9/7)は、▲0.12~▲0.10%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、30Y59~66、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、3M物が▲0.128%、1Y物が▲0.145~▲0.143%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還はなく、発行総額は300億円程度であった。発行レートは、横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オペアが、6,000億円でオファーされた。平均落札レート▲0.018%、按分レート▲0.042%と、前回比で平均は上昇し、按分は低下した。

●短期金融市場関連指標

2020/9/3	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	▲ 0.058				-	▲ 0.111	0.030	▲ 0.010	23,465.53	218.38	106.20-22	106.21-22
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.117						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.035				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.030	0.030	▲ 0.003				-	▲ 0.094						
3W			0.020				-	▲ 0.096						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.124	▲ 0.103						
6M							▲ 0.130	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.164						
									日付	8/27	8/28	8/31	9/1	9/2
									日銀当預残	4,635,700	4,648,400	4,642,200	4,618,900	4,593,600
									準備預金残	4,029,900	4,022,600	4,020,300	4,021,900	3,999,500
									マネタリーベース	5,822,000	5,835,100	5,828,600	5,804,700	5,779,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.054%	▲ 0.054%	▲ 0.057%	▲ 0.052%	▲ 0.051%
									コール市場残高	112,035	110,763	112,916	112,419	118,395
									うち無担	92,894	91,731	91,177	91,382	96,601
									うちO/N	58,761	57,798	59,004	60,209	63,828
									うち有担	19,141	19,032	21,739	21,037	21,794

●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)
30年利付国債	67	0.60%	9,000	2020/9/4	2050/6/20	25,654.0	7,338.0	99.5500	0.6170%	89.4984%	99.7100	0.6110%	1,654.0
交付税特会	-	-	10,000	2020/9/11	2021/3/12	291,132.0	10,000.00		0.0000%	3.4349%		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
CP等買入	6,000	2020/9/7			10,112	5,992	▲ 0.042		▲ 0.018	9.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/3	2020/9/4	▲ 0.350	231	231		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/3	2020/9/4	▲ 0.350	0	0				

●2020年9月4日の予定

*米国8月の雇用統計

*国庫短期証券(934回)入札

(3ヶ月、75,500億円、9/7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