

Central Daily Market Report

2020年9月4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9月4日		2020年9月7日		2020年9月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		900		1,000	
財政	▲ 4,500		▲ 500		2,000	
資金過不足	▲ 4,100		400		3,000	
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			1,800	▲ 2,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,300			
CP等買入		▲ 600	6,000	▲ 200		
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				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保提供供給		1,000				
当預増減	▲ 3,700		10,600		3,000	
当座預金残高	4,591,200		4,601,800		4,604,800	
準備預金残高	3,960,900					
積み終了先	3,960,900		9月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,960,900		積数		300	
非準備預金先	630,300		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 70.97%

●2020年9月4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▲0.087~▲0.03%の出会いとなった。立ち上がりは▲0.055~▲0.05%のレンジでまとまった出会いが見られた後、調達側のレートが急低下し▲0.087~▲0.055%での出会いとなった。ターム物に関してはロール案件の取引が中心となった。

<レポ市場>

GC T/N(9/7-9/8)は、▲0.13~▲0.11%程度での出会い。SCはロールオーダ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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB3M物(934回)の入札が実施された。WI取引において▲0.125~▲0.120%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1239%、按分落札利回▲0.1162%と順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.140~▲0.120% 出会いと強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.142%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還は少額で、発行総額は600円億程度。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

2020/9/4	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	▲ 0.057				-	▲ 0.106	0.035	0.005	23,205.43	▲ 260.10	106.08-10	106.16-18
T/N	▲ 0.060	▲ 0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.116						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.105						
3M							▲ 0.137	▲ 0.109						
6M							▲ 0.140	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.162						
									日付	8/28	8/31	9/1	9/2	9/3
									日銀当預残	4,648,400	4,642,200	4,618,900	4,593,600	4,594,900
									準備預金残	4,022,600	4,020,300	4,021,900	3,999,500	3,973,400
									マネタリーベース	5,835,100	5,828,600	5,804,700	5,779,500	5,780,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.054%	▲ 0.057%	▲ 0.052%	▲ 0.051%	▲ 0.058%
									コール市場残高	110,763	112,916	112,419	118,395	126,722
									うち無担	91,731	91,177	91,382	96,601	105,955
									うちO/N	57,798	59,004	60,209	63,828	70,987
									うち有担	19,032	21,739	21,037	21,794	20,767

●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)
国庫短期証券	934	-	75,500	2020/9/7	2020/12/7	189,507.0	61,563.6	100.0290	▲0.1162%	77.5038%	100.0309	▲0.1239%	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	2020/9/7	2020/9/23		1,801	1,801				
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/9/7			2,320	1,002	0.010		0.010	95.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/9/7			7,238	4,209	0.001		0.002	93.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/4	2020/9/7	▲ 0.350	50	50		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/4	2020/9/7	▲ 0.350	0	0				

●2020年9月7日の予定

*7月の景気動向指数速報

*New York祝日(Labor Day)

*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引

◆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