

Central Daily Market Report

2020年9月9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9日 | | 2020年9月10日 | | 2020年9月11日 | |
|-----------------------|-----------|--------|------------|--------|-----------------|-----------|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 700 | | 200 | | 0 | |
| 財政 | ▲ 20,900 | | ▲ 8,800 | | ▲ 11,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 20,200 | | ▲ 8,600 | | ▲ 11,000 | |
| 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 | 10,000 | | | | | |
| 国債買入 | | | | | | |
| CP等買入 | | ▲ 100 | | ▲ 800 | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | 3,000 | |
| 新型コロナ対応金融支援特別 | | | | | | |
| E T F買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 200 | 200 | | 200 | | |
| ※ドル資金供給用担保資産供給 | | | | | | |
| 当預増減 | ▲ 10,300 | | ▲ 9,200 | | ▲ 8,000 | |
| 当座預金残高 | 4,596,900 | | 4,587,700 | | 4,579,700 | |
| 準備預金残高 | 3,944,500 | | | | | |
| 積み終了先 | 3,944,500 | | | | 9月10日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 3,944,500 | | | | 積数 | 200 |
| 非準備預金先 | 652,400 | | | | 1日平均 | 0 |
| 積み期間(8/16~9/15)の所要準備額 | | | | | | 3,516,000 |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 99.99% | 日数 | 80.65% | | |

●2020年9月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前日に引き続きビッドサイドの参加者が少なく、低い水準での取引となった。立ち上がりは地銀・証券業態の調達を中心に▲0.087~▲0.05%での出会いとなった。一巡後は出し残るオファーも見られる中、▲0.087~▲0.06%近辺で散発的な出会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(9/10-9/11)は、▲0.11~▲0.085%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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB6M物(935回)の入札が実施された。WI取引において▲0.159~▲0.157%での出会いが見られたものの、平均落札利回▲0.1450%、按分落札利回▲0.1330%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.144%出会いと、やや堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は2.200億円程度に対し、発行総額は900億円強にとどまった。医薬品等からまとまったロットの発行が見られたが、小口の案件が中心であった。発行レートは、銘柄間で差はあるものの、概ねマイナス圏となっており、横ばい圏での決着であった。

●短期金融市場関連指標

| 2020/9/9 | 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 | ▲ 0.070 | | | | - | ▲ 0.104 | 0.025 | ▲ 0.010 | 23,032.54 | ▲ 241.59 | 105.96-98 | 105.93-94 |
| T/N | ▲ 0.066 | ▲ 0.010 | ▲ 0.014 | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.070 | ▲ 0.020 | ▲ 0.042 | | | | - | ▲ 0.107 | | | | | | |
| 2W | | | | | | | - | ▲ 0.112 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.121 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.121 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.137 | ▲ 0.123 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.144 | ▲ 0.143 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.150 | ▲ 0.164 | | | | | | |
| | | | | | | | | | 日付 | 9/2 | 9/3 | 9/4 | 9/7 | 9/8 |
| | | | | | | | | | 日銀当預残 | 4,593,600 | 4,594,900 | 4,591,200 | 4,594,400 | 4,607,200 |
| | | | | | | | | | 準備預金残 | 3,999,500 | 3,973,400 | 3,960,900 | 3,951,300 | 3,958,400 |
| | | | | | | | | | マネタリーベース | 5,779,500 | 5,780,800 | 5,776,700 | 5,779,100 | 5,791,000 |
| | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.051% | ▲0.058% | ▲0.057% | ▲0.064% | ▲0.066% |
| | | | | | | | | | コール市場残高 | 118,395 | 126,722 | 113,761 | 102,487 | 111,973 |
| | | | | | | | | | うち無担 | 96,601 | 105,955 | 94,013 | 85,037 | 94,118 |
| | | | | | | | | | うちO/N | 63,828 | 70,987 | 57,245 | 47,419 | 54,160 |
| | | | | | | | | | うち有担 | 21,794 | 20,767 | 19,748 | 17,450 | 17,855 |

●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 | 935 | - | 36,000 | 2020/9/10 | 2021/3/10 | 99,136.0 | 30,398.8 | 100.0660 | ▲0.1330% | 16.5454% | 100.0720 | ▲0.1450% | 5,601.0 |

●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 | 平均落札レート・利回較差 | 按分比率 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|---------|---------------|---------------|-----------------|------------|--------------|------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2020/9/9 | 2020/9/10 | ▲ 0.350 | 156 | 156 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2020/9/9 | 2020/9/10 | ▲ 0.350 | 15 | 15 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 米ドル資金供給 | | 2020/9/11 | 2020/9/17 | 0.350 | 640 | 640 | | | | |
| 米ドル資金供給 | | 2020/9/11 | 2020/12/3 | 0.330 | 585 | 585 | | | | |
| 社債等買入(残存期間1年以上3年以下) | 3,000 | 2020/9/11 | | | 5,427 | 3,001 | ▲0.053 | | ▲0.037 | 33.4 |

●2020年9月10日の予定

| | | |
|-------------------------------------|---|---|
| *7月の機械受注統計 (市場予想:電力除く民需、前月比1.9%) | *ECB定例理事会 *米国7月の卸売売上高 *米国8月の生産者物価指数 | *20年利付国債入札(12,000億円、9/11発行) *エネルギー対策借入(6,000億円、9/23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