

Central Daily Market Report

2020年9月10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10日		2020年9月11日		2020年9月14日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		500		0	
財政	▲ 8,100		▲ 9,500		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 7,900		▲ 9,000		▲ 26,000	
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 800		▲ 1,200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			3,000	▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						8,800
当預増減	▲ 8,600		▲ 7,200		▲ 17,200	
当座預金残高	4,588,300		4,581,100		4,563,900	
準備預金残高	3,955,000					
積み終了先	3,954,900				9月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,954,900				積数 200	
非準備預金先	633,300				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	83.87%		

●2020年9月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き低い水準での取引が中心となったものの、昨日までと比べ、ビッドサイドの参加者が若干増加したため、オファーの出し残りは減少した。立ち上がりは邦銀・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▲0.08~▲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(9/11-9/14)は、▲0.11~▲0.09%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2Y402~416、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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.140%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額が1,200億円強あったものの、発行は小口の案件が若干見られた程度であり、非常に閑散としたマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2020/9/10	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	▲ 0.073				-	▲ 0.094	0.024	▲ 0.001	23,235.47	202.93	106.23-24	106.05-07
T/N	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.020	▲ 0.055				-	▲ 0.099						
2W			0.010				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.116						
3M							▲ 0.137	▲ 0.121						
6M							▲ 0.145	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.164						
									日付	9/3	9/4	9/7	9/8	9/9
									日銀当預残	4,594,900	4,591,200	4,594,400	4,607,200	4,596,900
									準備預金残	3,973,400	3,960,900	3,951,300	3,958,400	3,944,600
									マネタリーベース	5,780,800	5,776,700	5,779,100	5,791,000	5,780,000
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.057%	▲0.064%	▲0.066%	▲0.070%
									コール市場残高	126,722	113,761	102,487	111,973	108,357
									うち無担	105,955	94,013	85,037	94,118	86,748
									うちO/N	70,987	57,245	47,419	54,160	47,350
									うち有担	20,767	19,748	17,450	17,855	21,609

●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)
20年利付国債	173	0.40%	12,000	2020/9/11	2040/6/20	36,362.0	9,846.0	99.7500	0.4130%	75.5975%	99.8500	0.4080%	2,146.0
エネルギー対策	-	-	6,000	2020/9/23	2021/9/21	136,099.0	5,999.92		0.0000%	4.4086%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/10	2020/9/11	▲ 0.350	97	97		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/10	2020/9/11	▲ 0.350	0	0				

●2020年9月11日の予定

*8月の企業物価指数	*米国8月の財政収支	*国庫短期証券(936回)入札
*7-9月期の法人企業景気予測調査季報	*米国8月の消費者物価指数	(3ヶ月、75,500億円、9/14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