

Central Daily Market Report

2020年9月11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11日		2020年9月14日		2020年9月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		200		0	
財政	▲ 12,500		▲ 26,600		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 12,000		▲ 26,400		▲ 1,000	
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			12,000			
CP等買入		▲ 1,200		▲ 900		
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		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供				9,000		
当増減	▲ 10,300		▲ 5,600		▲ 1,000	
当座預金残高	4,578,000		4,572,400		4,571,400	
準備預金残高	3,936,700					
積み終了先	3,936,600		9月14日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,936,600		積数		0	
非準備預金先	641,300		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	100.00%	日数	93.55%		

●2020年9月11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。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▲0.087~▲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(9/14-9/15)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>

本日は、TB3M物(936回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.126~▲0.120%での出会いが見られる中、平均落札利回り▲0.1178%、按分落札利回り▲0.1102%と、小甘い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.123~▲0.118%と、やや堅調な推移となった。この他に、6M物が▲0.155%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、2,200億円程度の償還に対し、電機・小売・不動産等の幅広い業態が大型発行を実施し、3,600億円程度の発行に膨らんだ。発行レートは、9月末越の案件を中心に、目線を切り下げる動きが散見された。

●短期金融市場関連指標

2020/9/11	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	▲ 0.074				-	▲ 0.102	0.020	▲ 0.004	23,406.49	171.02	106.15-16	106.23-24
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.108						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.108						
2W							-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.118						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.120	▲ 0.121						
6M							▲ 0.157	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.164						
									日付	9/4	9/7	9/8	9/9	9/10
									日銀当預残	4,591,200	4,594,400	4,607,200	4,596,900	4,588,300
									準備預金残	3,960,900	3,951,300	3,958,400	3,944,600	3,955,000
									マネタリーベース	5,776,700	5,779,100	5,791,000	5,780,000	5,771,200
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.064%	▲0.066%	▲0.070%	▲0.073%
									コール市場残高	113,761	102,487	111,973	108,357	112,877
									うち無担	94,013	85,037	94,118	86,748	87,786
									うちO/N	57,245	47,419	54,160	47,350	49,368
									うち有担	19,748	17,450	17,855	21,609	25,091

●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	936	-	75,500	2020/9/14	2020/12/14	178,411.0	61,563.5	100.0275	▲0.1102%	79.4924%	100.0294	▲0.1178%	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	申込総額(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	2020/9/14			6,913	4,201	▲0.010		▲0.001	16.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/9/14			9,229	3,504	▲0.005		▲0.004	17.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/9/14			11,059	4,210	▲0.007		▲0.005	14.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2020/9/11	2020/9/14	▲0.350	55	55		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2020/9/11	2020/9/14	▲0.350	0	0				

●2020年9月14日の予定

*7月の第3次産業活動指数

◆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