

Central Daily Market Report

2020年9月14日(月)
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14日		2020年9月15日		2020年9月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 100		0	
財政	▲ 29,700		2,800		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 29,700		2,700		▲ 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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,000		1,800			
CP等買入		▲ 900		▲ 1,100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					132,300	▲ 49,500
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
ETF買入	700					
国債補完供給	▲ 800			800		
※ドル資金供給用担保提供枠		9,000				
当預増減	▲ 9,700		4,200		77,800	
当座預金残高	4,568,300		4,572,500		4,650,300	
準備預金残高	3,961,600					
積み終了先	3,961,500					9月15日以降の残り所要積立額
超過準備	3,961,500					積数
非準備預金先	606,700					1日平均
						0
						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		96.77%

●2020年9月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.087~▲0.04%での出合いとなった。積み最終日を翌日に控え、取り調整から前営業日よりレートは僅かに上昇した。一巡後は閑散で、▲0.07%台の出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は閑散で、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(9/15-9/16)は、▲0.095~▲0.075%程度での出合い。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2Y413~416、5Y136~144、10Y340~359、20Y168~173、30Y62~67、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▲0.119%、6M物が▲0.156%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還550億円に対して発行が約300億円にとどまり、償還超であった。発行レートは概ねマイナス圏で横ばいながらも、入札件数が少なく閑散としていた。

●短期金融市場関連指標

2020/9/14	無担(速報)			有担(速報)			短期	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	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)	為替(17時)
単位: %							売買参考統計値	平均値	0.015	▲ 0.005	23,559.30	152.81	106.14-15	105.97-98
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.088						
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.033				-	▲ 0.098	日付	9/7	9/8	9/9	9/10	9/11
2W	▲ 0.045	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.102	日銀当預残	4,594,400	4,607,200	4,596,900	4,588,300	4,578,000
3W			0.100				-	▲ 0.112	準備預金残	3,951,300	3,958,400	3,944,600	3,955,000	3,936,700
1M			0.020				-	▲ 0.117	マネタリーベース	5,779,100	5,791,000	5,780,000	5,771,200	5,760,400
3M							▲ 0.120	▲ 0.120	無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.066%	▲ 0.070%	▲ 0.073%	▲ 0.074%
6M							▲ 0.160	▲ 0.144	コール市場残高	102,487	111,973	108,357	112,877	112,139
1Y							▲ 0.155	▲ 0.164	うち無担	85,037	94,118	86,748	87,786	90,678
									うちO/N	47,419	54,160	47,350	49,368	52,130
									うち有担	17,450	17,855	21,609	25,091	21,461

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/9/15			4,207	1,217	0.001		0.002	10.3
国債買入(物価連動債)	300	2020/9/15			1,789	300	▲0.200		▲0.243	20.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/14	2020/9/15	▲ 0.350	819	819		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/14	2020/9/15	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2020/9/16	2024/9/13	0	132,310

●2020年9月15日の予定

*7月の石油等消費動態統計	*米国FOMC(1日目)	*流動性供給入札(5,000億円、9/16発行)
	*米国8月の鉱工業生産・設備稼働率	

◆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