

Central Daily Market Report

2020年9月16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16日		2020年9月17日		2020年9月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 1,700		▲ 1,000	
財政	▲ 4,300		600		9,000	
資金過不足	▲ 4,500		▲ 1,100		8,000	
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	15,000					
国債買入			12,100			
CP等買入		▲ 400	6,000	▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	132,300	▲ 44,300				
被災地支援					800	▲ 800
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
※ドル資金供給用担保確保供給						15,100
当預増減	97,900		16,600		23,100	
当座預金残高	4,672,000		4,688,600		4,711,700	
準備預金残高	4,065,900					
積み終了先	2,630,200		9月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	1,164,600		積数		508,500	
非準備預金先	606,100		1日平均		17,500	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,409,900	
準備預金進捗率	実績	85.09%	日数	3.33%		

●2020年9月16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▲0.08～▲0.02%の出合い。新しい積み期間に入り、業態ごとに調達意欲の差が見られた。地銀業態の調達意欲は強く、一部では取り上がる動きも見られた。一巡後は閑散としたなか、▲0.07%台の出合いが見られた程度であった。ターム物は月内エンドのショートターム物を中心に、出合いが複数見られた。

＜レポ市場＞

GC T/N(9/17-9/18)は、▲0.09～▲0.08%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＞

本日は、TB1Y物(937回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.135～▲0.130%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1365%、按分落札利回▲0.1365%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、▲0.160～▲0.150%で出合いが見られるなど、堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.120%で出合った。

＜CP市場＞

CP市場は、償還2,200億円に対して大型の発行が数件実施されたことから約2,500億円と発行超であった。発行レートは概ねマイナス圏で推移し、一部の銘柄では強めの買いが見られた。

●短期金融市場関連指標

2020/9/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.056				-	▲ 0.083	0.015	0.000	23,475.53	20.64	105.40-41	105.24-26
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.050	▲ 0.015	▲ 0.033				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.120	▲ 0.119						
6M							▲ 0.160	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.163						
									日付	9/9	9/10	9/11	9/14	9/15
									日銀当預残	4,596,900	4,588,300	4,578,000	4,568,300	4,574,100
									準備預金残	3,944,600	3,955,000	3,936,700	3,961,600	3,985,500
									マネタリーベース	5,780,000	5,771,200	5,760,400	5,750,800	5,756,600
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.072%	▲0.052%
									コール市場残高	108,357	112,877	112,139	124,600	119,673
									うち無担	86,748	87,786	90,678	102,893	100,059
									うちO/N	47,350	49,368	52,130	64,845	63,061
									うち有担	21,609	25,091	21,461	21,707	19,614

●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	937	-	35,000	2020/9/23	2021/9/21	123,165.0	28,629.7	100.1360	▲0.1365%	96.9742%	100.1360	▲0.1365%	6,370.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/9/17			15,846	4,202	▲0.002		0.000	12.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/9/17			9,561	3,501	▲0.006		▲0.004	43.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/9/17			9,310	4,209	▲0.004		▲0.001	42.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア一分)		2020/9/16	2020/9/17	▲0.350	308	308		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2020/9/16	2020/9/17	▲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)	
被災地金融支援オペ	第3回	2020/9/18	2022/8/19	0	783

●2020年9月17日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
*黒田日銀総裁定例会見

*英中銀MPC結果発表
*米国8月の住宅着工件数
*ユーロ圏8月の消費者物価指数改定値

◆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