

Central Daily Market Report

2020年9月17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17日		2020年9月18日		2020年9月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 1,400		1,000	
財政	1,900		12,600		77,000	
資金過不足	200		11,200		78,000	
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						▲ 1,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,100					
CP等買入	6,000	▲ 700		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			800	▲ 800		
社債等買入				▲ 700		
新型コロナ対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 700	300		700		
※ドル資金供給用担保提供供給				15,500		
当預増減	17,200		25,900		76,200	
当座預金残高	4,689,200		4,715,100		4,791,300	
準備預金残高	4,067,900					
積み終了先	3,998,500		9月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,612,000		積数	52,600		
非準備預金先	621,300		1日平均	1,900		
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	98.46%	日数	6.67%		

●2020年9月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前営業日に続き地銀業態を中心に取り上がる動きが見られ、▲0.083~▲0.01%での出会いとなった。一巡後も調達意欲は強いものの、オファーに限られ▲0.07%台の出会いが散見された程度で本日の取引を終えた。ターム物は引き続き月内物の引き合いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/N(9/18~9/23)は、▲0.10~▲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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、償還2,000億円に対して調達総額が約1,200億円と償還超であった。発行レートは、積極的な応札が少なく、銘柄によりまちまちであったが、概ね横ばい圏で推移した。

●2020年9月18日の予定

- *4-6月期の資金循環統計速報
- *8月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.4%)
- *米国9月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *国庫短期証券(938回)入札(3ヶ月、75,500億円、9/23発行)
- *流動性供給入札(4,000億円、9/23発行)

●短期金融市場関連指標

2020/9/17	無担(速報)			有担(速報)			短国	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)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.089	0.010	▲ 0.005	23,319.37	▲ 156.16	105.05-07	104.76-78
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.022				-	▲ 0.098						
2W							-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.109						
1M			0.010				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.120	▲ 0.118						
6M							▲ 0.164	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.163						
日付		9/10	9/11	9/14	9/15	9/16								
日銀当預残		4,588,300	4,578,000	4,568,300	4,574,100	4,672,000								
準備預金残		3,955,000	3,936,700	3,961,600	3,985,500	4,065,900								
マネタリーベース		5,771,200	5,760,400	5,750,800	5,756,600	5,854,700								
無担O/N加重平均		▲0.073%	▲0.074%	▲0.072%	▲0.052%	▲0.056%								
コール市場残高		112,877	112,139	124,600	119,673	122,430								
うち無担		87,786	90,678	102,893	100,059	102,494								
うちO/N		49,368	52,130	64,845	63,061	64,596								
うち有担		25,091	21,461	21,707	19,614	19,936								

●入札結果

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)	授分レート・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	授分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/17	2020/9/18	▲ 0.350	591	591		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/17	2020/9/18	▲ 0.350	0	0				

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。

(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとする。

(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する。)

(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)

①ETFおよびJ-REITについて、当面は、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、積極的な買入れを行う。

(ETFおよびJ-REITの原則的な買入れ方針としては、引き続き、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行い、その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。)

②CP等、社債等については、それぞれ約2兆円、約3兆円の残高を維持する。これに加え、2021年3月末までの間、それぞれ7.5兆円の残高を上限に、追加の買入れを行う。

◆本資料は信頼できるとさ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