

Central Daily Market Report

2020年9月18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18日		2020年9月23日		2020年9月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		800			0
財政	10,900		80,400			▲ 2,000
資金過不足	9,400		81,200			▲ 2,000
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			3,800	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 800		▲ 900		
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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 300	700		300		
※ドル資金供給用担保提供		15,500				
当増減	23,800		82,600			▲ 2,000
当座預金残高	4,713,000		4,795,600			4,793,600
準備預金残高	4,069,700					
積み終了先	4,068,400		9月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,060,700		積数	7,300		
非準備預金先	643,300		1日平均	300		
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	99.79%	日数	23.33%		

●2020年9月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀業態を中心に調達ニーズが非常に強い状況の中、連休を挟んだことで5日積みとなったことで、レート水準は前日比で上昇した。業態により調達意欲に差異があることから、出合いは▲0.08~▲0.01%とワイドレンジであった。ターム物は月内エンドで▲0.02%台の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(9/23-9/24)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TB3M物(938回)の入札が実施された。WI取引において▲0.120~▲0.110%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1107%、按分落札利回▲0.1045%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.114~▲0.111%出合いと、入札と同水準で推移した。この他に、6M物が▲0.167%、1Y物が▲0.160%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、1,500億円の償還に対し、石油業態から大型の調達を実施されたものの、発行総額は約1,200億円にとどまった。発行レートは概ねマイナス圏で、横ばいでの推移となった。

●短期金融市場関連指標

2020/9/18	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	▲ 0.046				-	▲ 0.090	0.010	0.000	23,360.30	40.93	104.70-72	104.57-58
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.093						
2W							-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.112	▲ 0.118						
6M							▲ 0.167	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.163						
									日付	9/11	9/14	9/15	9/16	9/17
									日銀当預残	4,578,000	4,568,300	4,574,100	4,672,000	4,689,200
									準備預金残	3,936,700	3,961,600	3,985,500	4,065,900	4,067,900
									マネタリーベース	5,760,400	5,750,800	5,756,600	5,854,700	5,873,600
									無担O/N加重平均	▲0.074%	▲0.072%	▲0.052%	▲0.056%	▲0.051%
									コール市場残高	112,139	124,600	119,673	122,430	127,926
									うち無担	90,678	102,893	100,059	102,494	107,876
									うちO/N	52,130	64,845	63,061	64,596	69,378
									うち有担	21,461	21,707	19,614	19,936	20,050

●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	938	-	75,500	2020/9/23	2020/12/21	209,865.0	61,580.50	100.0255	▲0.1045%	13.4373%	100.0270	▲0.1107%	13,919.0
流動性供給	318	-	4,000	2020/9/23		14,210.0	3,995.0		▲0.0080%	56.0336%		▲0.0100%	

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2020/9/23	2020/10/5		3,801	3,801				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/18	2020/9/23	▲ 0.350	288	288		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/18	2020/9/23	▲ 0.350	0	0				

●2020年9月21日の予定

*敬老の日

●2020年9月22日の予定

*秋分の日
*米国8月の中古住宅販売

●2020年9月23日の予定

*黒田日銀総裁、大阪経済4団体共催懇談会にて講演

◆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