

# Central Daily Market Report

2020年9月23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23日		2020年9月24日		2020年9月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		▲ 300		▲ 1,000	
財政	71,500		1,600		▲ 3,000	
資金過不足	72,100		1,300		▲ 4,000	
<b>金融調節</b>						
	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			10,000			
国債買入			13,100			
CP等買入		▲ 900		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					2,000	
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>						
当増減	73,400		24,000		▲ 2,000	
当座預金残高	4,786,400		4,810,400		4,808,400	
準備預金残高	4,144,900					
積み終了先	4,143,500					
超過準備	4,143,500					
非準備預金先	641,500					
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	99.83%	日数	26.67%		

## ●2020年9月23日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き全般的に強めの地合いで推移した。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~▲0.015%とワイドレンジとなった。ターム物は、特段出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(9/24-9/25)は、▲0.095~▲0.105%程度での出合い。SCI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、短国買入オペアが前回より5,000億円減額の1兆円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.005%、按分落札利回り較差+0.003%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.120~▲0.115%、1Y物が▲0.163%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額6,000億円程度に対して、発行総額は2,500億円程度と大きく償還超であった。一部の機械業態において大型発行があったものの、その他は小型案件を中心とする落ち着いたマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/9/23	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				-	▲ 0.091	0.005	▲ 0.005	23,346.49	▲ 13.81	105.05-06	104.97-98
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.104						
2W			0.170				-	▲ 0.104						
3W							-	▲ 0.107						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.121	▲ 0.118						
6M							▲ 0.167	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.164						
									日付	9/14	9/15	9/16	9/17	9/18
									日銀当預残	4,568,300	4,574,100	4,672,000	4,689,200	4,713,000
									準備預金残	3,961,600	3,985,500	4,065,900	4,067,900	4,069,700
									マネタリーベース	5,750,800	5,756,600	5,854,700	5,873,600	5,898,800
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.052%	▲0.056%	▲0.051%	▲0.046%
									コール市場残高	124,600	119,673	122,430	127,926	129,942
									うち無担	102,893	100,059	102,494	107,876	108,873
									うちO/N	64,845	63,061	64,596	69,378	68,580
									うち有担	21,707	19,614	19,936	20,050	21,069

## ●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	棄分率	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
国庫短期証券買入	10,000	2020/9/24			27,800	10,001	0.003		0.005	57.9
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/9/24			2,672	1,002	0.005		0.006	62.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/9/24			12,222	4,203	▲0.008		▲0.006	17.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/9/24			10,332	3,504	▲0.009		▲0.008	84.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/9/24			9,971	4,212	▲0.007		▲0.006	86.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/23	2020/9/24	▲0.350	109	109		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/23	2020/9/24	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/9/25	2020/10/1	0.340	670	670				
米ドル資金供給		2020/9/25	2020/12/17	0.330	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/9/25			3,451	2,000	0.133		0.154	3.5

## ●2020年9月24日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(7月14、15日分)	*8月の米新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(939回)入札(6ヶ月、37,000億円、9/25発行)
*月例経済報告		*40年利付国債入札(5,000億円、9/25発行)

◆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