Central Daily Market Report

2020年9月24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24日 需給速報		2020年9月25日 需給予想		2020年9月28日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 700		1,000	
財政	2,500		▲ 35,900		2,000	
資金過不足	2,400		▲ 36,600		3,000	
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	10,000					
国債買入	13,100					
CP等買入		▲ 500		▲ 2,000		
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			99,900			
ＥＴＦ買入			200			
国債補完供給	▲ 200	100		200		
＊ドル資金供給用担保国債供給						1,600
当預増減	24,900		63,700		4,600	

当座預金残高	4,811,300	4,875,000	4,879,600
準備預金残高	4,171,100		
積み終了先	4,170,900		
超過準備	4,170,200		
非準備預金先	640,200		

9月25日以降の残り所要積立額	
積数	5,100
1日平均	200

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	99.85%	日数 30.00%

●2020年9月24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▲0.055～▲0.015%の出合い。昨日に比べ調達姿勢を強めた先が多く、出合い水準は上昇した。一巡後は、▲0.05%前後で数件の出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(9/25-9/28)は、▲0.115～▲0.10%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TB6M物（939回）の入札が実施された。WI取引において▲0.141～▲0.130%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1430%、按分落札利回▲0.1410%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.160～▲0.158%出合いと堅調に推移した。

<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3,000億円程度に対して、発行総額は150億円程度と大きく償還超であった。案件数が少なく閑散とし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

2020/9/24	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.038				－	▲ 0.102
T/N	▲ 0.038	▲ 0.015	▲ 0.035				－	▲ 0.103
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.300	0.048				－	▲ 0.108
2W							－	▲ 0.108
3W			▲ 0.030				－	▲ 0.109
1M							－	▲ 0.114
3M							▲ 0.129	▲ 0.121
6M							▲ 0.160	▲ 0.143
1Y							▲ 0.163	▲ 0.164

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.005	0.000	23,087.82	▲ 258.67	105.31-32	105.30-31

日付	9/15	9/16	9/17	9/18	9/23
日銀当預残	4,574,100	4,672,000	4,689,200	4,713,000	4,786,400
準備預金残	3,985,500	4,065,900	4,067,900	4,069,700	4,144,900
マネタリーベース	5,756,600	5,854,700	5,873,600	5,898,800	5,971,700
無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.056%	▲0.051%	▲0.046%	▲0.046%
コール市場残高	119,673	122,430	127,926	129,942	134,741
うち無担	100,059	102,494	107,876	108,873	113,951
うちO/N	63,061	64,596	69,378	68,580	75,418
うち有担	19,614	19,936	20,050	21,069	20,790

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	939	－	37,000	2020/9/25	2021/3/25	137,282.0	30,177.50	100.0700	▲0.1410%	75.6623%	100.0710	▲0.1430%	6,822.0
40年利付国債	13	0.50%	5,000	2020/9/25	2060/3/20	13,245.0	4,993.0	96.1500	0.6100%	86.3557%			

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/9/24	2020/9/25	▲ 0.350	188	188		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/9/24	2020/9/25	▲ 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）	（参考）2020/9/25時点の貸出残高（億円）
新型コロナ対応金融支援特別	2020/9/25	2021/3/25	0	99,869	450,038

●2020年9月25日の予定

*8月の企業向けサービス価格指数
*米国8月の米耐久財新規受注
*国庫短期証券(940回)入札
（3ヶ月、75,500億円、9/28発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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