

Central Daily Market Report

2020年9月28日(月)
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28日		2020年9月29日		2020年9月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		100		100	
財政	▲ 4,600		▲ 6,800		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 4,100		▲ 6,700		▲ 1,900	
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						
国債買入			9,100			
CP等買入		▲ 1,000	6,000	▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			400			
国債補完供給		900				
※ドル資金供給用担保提供枠		1,600				
当預増減	▲ 2,600		7,900		▲ 1,900	
当座預金残高	4,871,800		4,879,700		4,877,800	
準備預金残高	4,222,600					
積み終了先	4,222,400			9月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,222,400			積数	3,800	
非準備預金先	649,200			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	99.89%	日数	43.33%		

●2020年9月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態を中心に▲0.045~▲0.015%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一巡後は▲0.03%近辺での出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(9/29-9/30)は、▲0.095~▲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、5Y140~144、10Y340~359、20Y170~173、30Y62~67、40Y9~13等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日の短国市場は動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.185%、6M物が▲0.158~▲0.150%、1Y物が▲0.164%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は月末発行にあたり、幅広い業態において大型発行が実施されたが、四半期末の大量償還によることから償還総額2兆5,000億円程度に對して、発行総額は6,000億円程度と大幅な償還超となった。発行レートはマイナスイナス圏のままで、概ね前日比横ばいの動きであった。

●短期金融市場関連指標

2020/9/28	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	▲ 0.032				-	▲ 0.094	0.020	0.015	23,511.62	307.00	105.58-59	105.34-36
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W			0.300				-	▲ 0.109						
2W							-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.110						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.185	▲ 0.124						
6M							▲ 0.159	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.164	▲ 0.163						
									日付	9/17	9/18	9/23	9/24	9/25
									日銀当預残	4,689,200	4,713,000	4,786,400	4,811,300	4,874,400
									準備預金残	4,067,900	4,069,700	4,144,900	4,171,100	4,229,400
									マネタリーベース	5,873,600	5,898,800	5,971,700	5,996,700	6,060,400
									無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.046%	▲0.046%	▲0.038%	▲0.030%
									コール市場残高	127,926	129,942	134,741	132,275	143,771
									うち無担	107,876	108,873	113,951	112,935	120,757
									うちO/N	69,378	68,580	75,418	73,522	77,414
									うち有担	20,050	21,069	20,790	19,340	23,014

●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	案分率	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	応募総額(億円・百万ドル)	種別総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均種別レート・利回較差・価格較差	貸付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/9/29			9,590	4,204	0.002		0.003	84.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/9/29			15,373	4,202	0.004		0.004	77.1
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/9/29			1,363	304	0.014		0.015	63.2
国債買入(物価連動債)	300	2020/9/29			1,439	303	▲0.150		▲0.201	46.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/28	2020/9/29	▲ 0.350	14	14		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/28	2020/9/29	▲ 0.350	0	0				

●2020年9月29日の予定

- *決定会合における主な意見(9月16、17日分)
- *9月の東京都区部消費者物価指数(CPI)
- (市場予想:前年同月比(除く生鮮)▲0.3%)
- *米国7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- *米国9月のCB消費者信頼感指数
- *2年利付国債入札(30,000億円、10/1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