Central Daily Market Report

2020年9月29日（火）
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29日 需給速報		2020年9月30日 需給予想		2020年10月1日 当社予想	
銀行券	100		▲ 300		0	
財政	▲ 6,600		▲ 1,200		▲ 29,000	
資金過不足	▲ 6,500		▲ 1,500		▲ 29,000	
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	9,100					
CP等買入	6,000	▲ 900		▲ 11,500		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入	400					
国債補完供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	7,900		▲ 2,800		▲ 29,000	
当座預金残高	4,879,700		4,876,900		4,847,900	
準備預金残高	4,228,600					
積み終了先	4,228,500					
超過準備	4,228,500					
非準備預金先	651,100					
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	46.67%		

9月30日以降の残り所要積立額	
積数	3,600
1日平均	200

●2020年9月29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▲0.04～▲0.015%での調達で始まった。引き続き調達意欲は強く、一巡後も▲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(9/30-10/1)は、▲0.12～▲0.095%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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペが前回と同額の1兆円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.009%、按分落札利回り較差+0.006%と、やや弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.175%、6M物が▲0.156～▲0.155%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は期明け発行にあたり、鉄鋼、商社、機械等の業態において大型発行が実施された。償還総額1,300億円程度に対して、発行総額は5,000億円程度と発行超となった。発行レートはマイナス圏のままで、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

2020/9/29	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.031				－	▲ 0.103
T/N	▲ 0.087	▲ 0.001	▲ 0.024				－	▲ 0.111
S/N							－	－
1W			▲ 0.025				－	▲ 0.107
2W							－	▲ 0.107
3W							－	▲ 0.108
1M							－	▲ 0.113
3M							▲ 0.182	▲ 0.124
6M							▲ 0.159	▲ 0.145
1Y							▲ 0.164	▲ 0.166

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）
0.015	▲ 0.005	23,539.10	27.48	105.44-46	105.55-57

日付	9/18	9/23	9/24	9/25	9/28
日銀当預残	4,713,000	4,786,400	4,811,300	4,874,400	4,871,800
準備預金残	4,069,700	4,144,900	4,171,100	4,229,400	4,222,600
マネタリーベース	5,898,800	5,971,700	5,996,700	6,060,400	6,057,300
無担O/N加重平均	▲0.046%	▲0.046%	▲0.038%	▲0.030%	▲0.032%
コール市場残高	129,942	134,741	132,275	143,771	131,894
うち無担	108,873	113,951	112,935	120,757	109,736
うちO/N	68,580	75,418	73,522	77,414	69,073
うち有担	21,069	20,790	19,340	23,014	22,158

●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)
2年利付国債	417	0.10%	30,000	2020/10/1	2022/10/1	98,561.0	24,506.00	100.4800	▲0.1390%	64.8471%	100.4850	▲0.1410%	5,485.0

●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	2020/9/30			38,796	10,002	0.006		0.009	35.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/9/29	2020/9/30	▲ 0.350	241	241		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/9/29	2020/9/30	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/10/1	2020/10/8	0.340	800	800				
米ドル資金供給		2020/10/1	2020/12/24	0.330	0	0				

●2020年9月30日の予定

*8月の商業動態統計速報
*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比＋1.5%）
*8月の住宅着工統計
*米国4-6月期のGDP確報値
*米国9月のシカゴPM景況感指数
*英国4-6月期のGDP確報値
*ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値

◆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