

Central Daily Market Report

2020年9月30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30日		2020年10月1日		2020年10月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 1,100		▲ 29,200		▲ 65,000	
資金過不足	▲ 1,400		▲ 30,100		▲ 66,000	
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			4,600			
CP等買入		▲ 11,500		▲ 300		
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			800			
国債補完供給	▲ 2,400	200		2,400		
※ドル資金供給用担保提供供給						1,600
当預増減	▲ 5,100		▲ 22,600		▲ 64,400	
当座預金残高	4,874,600		4,852,000		4,787,600	
準備預金残高	4,258,000					
積み終了先	4,257,900				10月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,254,600				積数	200
非準備預金先	616,600				1日平均	0
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	99.99%	日数	50.00%		

●2020年9月30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▲0.07～▲0.03%での調達で始まった。四半期末日にあたることから調達を控える先も見られ、昨日よりも軟調な地合いとなった。一巡後は▲0.07%近辺での出会いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GCT/N(10/1-10/2)は、▲0.095～▲0.08%程度での出会い。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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.180～▲0.175%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は商社業態において大型発行が実施された。償還総額250億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と発行超となった。発行レートは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

2020/9/30	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.061				-	▲ 0.102	0.010	▲ 0.005	23,185.12	▲ 353.98	105.67-68	105.61-62
T/N	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.039				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.106						
1M	▲ 0.020	0.180	▲ 0.010				-	▲ 0.112						
3M			0.080				▲ 0.177	▲ 0.129						
6M							▲ 0.159	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.161	▲ 0.164						
									日付	9/23	9/24	9/25	9/28	9/29
									日銀当預残	4,786,400	4,811,300	4,874,400	4,871,800	4,879,700
									準備預金残	4,144,900	4,171,100	4,229,400	4,222,600	4,228,600
									マネタリーベース	5,971,700	5,996,700	6,060,400	6,057,300	6,065,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.038%	▲ 0.030%	▲ 0.032%	▲ 0.031%
									コール市場残高	134,741	132,275	143,771	131,894	138,589
									うち無担	113,951	112,935	120,757	109,736	117,692
									うちO/N	75,418	73,522	77,414	69,073	78,569
									うち有担	20,790	19,340	23,014	22,158	20,897

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/10/1			2,010	1,002	0.008		0.010	97.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/10/1			11,710	3,505	▲0.001		0.000	59.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/30	2020/10/1	▲ 0.350	2,360	2,360		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/30	2020/10/1	▲ 0.350	27	27		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2020年10月1日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨) 市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI):▲23	*米国8月の個人所得・消費支出 *米国8月の建設支出 *米国9月のISM製造業景況指数	*10年利付国債入札 (26,000億円、10/2発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、10/9借入)
---	---	--

◆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