Central Daily Market Report

2020年9月1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1日 需給速報		2020年9月2日 需給予想		2020年9月3日 当社予想	
銀行券	600		▲ 100		0	
財政	▲ 32,700		▲ 43,700		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 32,100		▲ 43,800		▲ 4,000	
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			20,000			
国債買入	8,800					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金（成）			1,800	▲ 3,000		
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 100	200		100		
＊ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 23,300		▲ 25,200		▲ 4,000	

当座預金残高	4,618,900	4,593,700	4,589,700
準備預金残高	4,021,900		
積み終了先	4,021,800		
超過準備	4,021,800		
非準備預金先	597,000		

9月2日以降の残り所要積立額	
積数	600
1日平均	0

積み期間（8/16～9/15）の所要準備額			3,499,200
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数 54.84%

●2020年9月1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%の出合いとなった。取り急ぐ動きも見られず、一巡後はビッドが薄くなり、調整から▲0.07～▲0.05%の出合いが見られた。ターム物に関しては月内エンドのショートターム物で出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(9/2-9/3)は、▲0.090～▲0.080%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2Y402～415、5Y136～144、10Y335～359、20Y167～173、30Y59～67、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20,000億円でオファーされた。応札額がやや多めで、平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回較差+0.004%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▲0.124%、6M物が▲0.122～▲0.1175%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、1件のみの発行と閑散で、償還総額は200億円程度であった。

●短期金融市場関連指標

2020/9/1	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	▲ 0.052				－	▲ 0.089
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.094
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.028				－	▲ 0.088
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.019				－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.088
1M							－	▲ 0.092
3M							▲ 0.124	▲ 0.097
6M							▲ 0.122	▲ 0.137
1Y							▲ 0.143	▲ 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）
0.040	▲ 0.005	23,138.07	▲ 1.69	105.99-00	105.65-67

日付	8/25	8/26	8/27	8/28	8/31
日銀当預残	4,481,600	4,476,900	4,635,700	4,648,400	4,642,200
準備預金残	3,898,900	3,890,700	4,029,900	4,022,600	4,020,300
マネタリーベース	5,666,700	5,662,400	5,822,000	5,835,100	5,828,600
無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.051%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.057%
コール市場残高	114,441	111,542	112,035	110,763	112,916
うち無担	95,693	92,953	92,894	91,731	91,177
うちO/N	62,515	59,475	58,761	57,798	59,004
うち有担	18,748	18,589	19,141	19,032	21,739

●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)
10年利付国債	359	0.10%	26,000	2020/9/2	2030/6/20	66,798.0	21,180.0	100.5300	0.0450%	21.1681%	100.6400	0.0340%	4,793.0

●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	20,000	2020/9/2			59,059	20,001	0.004		0.007	65.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/9/1	2020/9/2	▲ 0.350	76	76		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/9/1	2020/9/2	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/9/3	2020/9/11	0.340	10	10				
米ドル資金供給		2020/9/3	2020/11/27	0.330	355	355				

●2020年9月2日の予定

*8月実績/9月見込み財政資金対民間収支
*8月のマネタリーベース
*米国ベージュブック
*米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫

◆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