

# Central Daily Market Report

2020年9月7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7日 |         | 2020年9月8日 |        | 2020年9月9日 |     |
|---------------------------------|-----------|---------|-----------|--------|-----------|-----|
|                                 | 需給速報      |         | 需給予想      |        | 当社予想      |     |
| 銀行券                             | 800       |         | 900       |        | 0         |     |
| 財政                              | ▲ 7,700   |         | 1,900     |        | ▲ 20,000  |     |
| 資金過不足                           | ▲ 6,900   |         | 2,800     |        | ▲ 20,000  |     |
| <b>金融調節</b>                     | 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                            | 1,800     | ▲ 2,800 |           |        |           |     |
| 国債買現                            |           |         |           |        |           |     |
| 国債売現                            |           |         |           |        |           |     |
| 国庫短期証買入                         |           |         |           |        |           |     |
| 国債買入                            | 5,300     |         | 8,100     |        |           |     |
| CP等買入                           | 6,000     | ▲ 200   |           |        |           |     |
| 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                        |           |         |           |        |           |     |
| 国債補完供給                          | ▲ 100     | 100     |           | 100    |           |     |
| <small>※トータル資金供給は国債補完供給</small> |           |         |           |        |           |     |
| 当預増減                            | 3,200     |         | 11,000    |        | ▲ 20,000  |     |
| 当座預金残高                          | 4,594,400 |         | 4,605,400 |        | 4,585,400 |     |
| 準備預金残高                          | 3,951,200 |         |           |        |           |     |
| 積み終了先                           | 3,951,200 |         |           |        |           |     |
| 超過準備                            | 3,951,200 |         |           |        |           |     |
| 非準備預金先                          | 643,200   |         |           |        |           |     |
| 積み期間(8/16~9/15)の所要準備額           |           |         |           |        | 3,516,000 |     |
| 準備預金進捗率                         | 実績        | 99.99%  | 日数        | 74.19% |           |     |

## ●2020年9月7日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、ビッドサイドの参加者が少なく、前営業日と比べ低い水準での取引となった。立ち上がりは地銀・証券業態等の調達を中心に▲0.085~▲0.055%での出会いとなった。一巡後は出し残るオファーも見られる中、▲0.087~▲0.06%近辺で散発的な出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1~2W物のショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(9/8-9/9)は、▲0.16~▲0.11%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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.140%、6M物が▲0.144%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額が限定的だったこともあり、発行総額も200億円程度にとどまり、小口の案件が少数見られた程度であった。発行レートは概ねマイナス圏となっており、ほぼ横ばいの動きであった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2020/9/7 | 無担(速報)  |         |         | 有担(速報) |    |    | 短国<br>売買参考値 | 東京<br>レポレート<br>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   | ▲ 0.064 |        |    |    | -           | ▲ 0.127            | 0.040     | 0.005     | 23,089.95 | ▲ 115.48  | 106.31-32 | 106.19-20 |
| T/N      | ▲ 0.070 | ▲ 0.001 | ▲ 0.024 |        |    |    | -           | ▲ 0.161            |           |           |           |           |           |           |
| S/N      |         |         |         |        |    |    | -           | -                  |           |           |           |           |           |           |
| 1W       | ▲ 0.060 | 0.000   | ▲ 0.037 |        |    |    | -           | ▲ 0.144            |           |           |           |           |           |           |
| 2W       | ▲ 0.050 | 0.180   | ▲ 0.029 |        |    |    | -           | ▲ 0.128            |           |           |           |           |           |           |
| 3W       | 0.001   | 0.025   | 0.010   |        |    |    | -           | ▲ 0.125            |           |           |           |           |           |           |
| 1M       |         |         |         |        |    |    | -           | ▲ 0.124            |           |           |           |           |           |           |
| 3M       |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.140     | ▲ 0.124            |           |           |           |           |           |           |
| 6M       |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.144     | ▲ 0.142            |           |           |           |           |           |           |
| 1Y       |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.148     | ▲ 0.165            |           |           |           |           |           |           |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | 日付        | 8/31      | 9/1       | 9/2       | 9/3       | 9/4       |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | 日銀当預残     | 4,642,200 | 4,618,900 | 4,593,600 | 4,594,900 | 4,591,200 |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | 準備預金残     | 4,020,300 | 4,021,900 | 3,999,500 | 3,973,400 | 3,960,900 |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | マネタリーベース  | 5,828,600 | 5,804,700 | 5,779,500 | 5,780,800 | 5,776,700 |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.057%  | ▲ 0.052%  | ▲ 0.051%  | ▲ 0.058%  | ▲ 0.057%  |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | コール市場残高   | 112,916   | 112,419   | 118,395   | 126,722   | 113,761   |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | うち無担      | 91,177    | 91,382    | 96,601    | 105,955   | 94,013    |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | うちO/N     | 59,004    | 60,209    | 63,828    | 70,987    | 57,245    |
|          |         |         |         |        |    |    |             |                    | うち有担      | 21,739    | 21,037    | 21,794    | 20,767    | 19,748    |

## ●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年超3年以下)         | 4,200          | 2020/9/8 |          |         | 7,433         | 4,207         | 0.000           |                 | 0.002             | 56.8 |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下)         | 3,500          | 2020/9/8 |          |         | 10,237        | 3,503         | 0.002           |                 | 0.004             | 58.0 |
| 国債買入(残存期間25年超)            | 300            | 2020/9/8 |          |         | 1,117         | 303           | 0.018           |                 | 0.018             | 80.9 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) |                | 2020/9/7 | 2020/9/8 | ▲ 0.350 | 96            | 96            |                 | ▲ 0.350         | ▲ 0.350           |      |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) |                | 2020/9/7 | 2020/9/8 | ▲ 0.350 | 0             | 0             |                 |                 |                   |      |

## ●2020年9月8日の予定

|                                  |                   |                           |
|----------------------------------|-------------------|---------------------------|
| *4-6月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率▲28.6%) | *米国7月の消費者信用残高     | *5年利付国債入札(25,000億円、9/9発行) |
| *7月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲3.7%)  | *ユーロ圏4-6月期のGDP確報値 |                           |
| *7月の毎月勤労統計調査速報                   |                   |                           |
| *7月の国際収支                         |                   |                           |
| *7月の特定サービス産業動態統計速報               |                   |                           |
| *8月の景気ウオッチャー調査                   |                   |                           |

◆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