

Central Daily Market Report

2020年9月15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15日		2020年9月16日		2020年9月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 200		▲ 1,000	
財政	4,400		▲ 4,600		0	
資金過不足	4,400		▲ 4,800		▲ 1,000	
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			15,000			
国債買入	1,800					
CP等買入		▲ 1,100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			132,300	▲ 44,300		
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	800		100		
米ドル資金供給用担保国債供給						
当座増減	5,800		97,900		▲ 1,000	
当座預金残高	4,574,100		4,672,000		4,671,000	
準備預金残高	3,985,500					
積み終了先	3,985,500		9月16日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,985,500		積数		3,409,900	
非準備預金先	588,600		1日平均		113,700	
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	0.00%	日数	0.00%		

●2020年9月15日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、積み最終日による調整から、前営業日に続き取り上げる展開となった。立ち上がりは国内勢より▲0.075～▲0.025%の出合い。一巡後も調達意欲は強かったものの、オファー案件が少なく、▲0.04%前後で数件の出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は来積み期スタートの月内物で、引き合いが複数見られた。

＜レポ市場＞

GC T/N(9/16-9/17)は、▲0.09～▲0.08%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、5Y136～144、10Y340～359、20Y168～173、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より5,000億円増額の15,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.007%、按分落札利回り較差0.004%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.118%、6M物が▲0.158～▲0.157%で出合った。

＜CP市場＞

CP市場は、償還1,200億円に対して発行が約600億円と償還超であった。発行レートは、銘柄によりまちまちであった。本日はCP買入オペが6,000億円でオファーされた。応札額が少なかったこともあり、平均落札レート▲0.039%、按分レート▲0.058%と、前回(平均▲0.018%・按分▲0.042%)比で両レートとも低下する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/9/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.081	0.015	0.000	23,454.89	▲ 104.41	105.72-74	105.74-75
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.050	▲ 0.012	▲ 0.038				-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.109						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.120	▲ 0.119						
6M							▲ 0.158	▲ 0.144						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.163						
									日付	9/8	9/9	9/10	9/11	9/14
									日銀当預残	4,607,200	4,596,900	4,588,300	4,578,000	4,568,300
									準備預金残	3,958,400	3,944,600	3,955,000	3,936,700	3,961,600
									マネタリーベース	5,791,000	5,780,000	5,771,200	5,760,400	5,750,800
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.070%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.072%
									コール市場残高	111,973	108,357	112,877	112,139	124,600
									うち無担	94,118	86,748	87,786	90,678	102,893
									うちO/N	54,160	47,350	49,368	52,130	64,845
									うち有担	17,855	21,609	25,091	21,461	21,707

●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1非価格競争入札(億円)
流動性供給	317	-	5,000	2020/9/16		20,839.0	4,973.0		0.0020%	13.5874%		0.0000%	

●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	15,000	2020/9/16			37,649	15,002	0.004		0.007	69.8
CP等買入	6,000	2020/9/17			8,906	6,000	▲0.058		▲0.039	11.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/9/15	2020/9/16	▲ 0.350	30	30		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/9/15	2020/9/16	▲ 0.350	20	20		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/9/17	2020/9/25	0.340	742	742				
米ドル資金供給		2020/9/17	2020/12/10	0.330	165	165				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/9/16	2020/9/28		2	2		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年9月16日の予定

*日銀金融政策委員会・金融政策決定会合(1日目、17日まで)	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(937回)入札(1年、35,000億円、9/23発行)
*8月の貿易統計	*米国FRB経済見通し発表	
	*米国7月の企業在庫	
	*米国8月の小売売上高	
	*英国8月の消費者物価指数	

◆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