

Central Daily Market Report

2020年8月3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8月3日		2020年8月4日		2020年8月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		300		0	
財政	▲ 47,100		▲ 58,500		▲ 22,000	
資金過不足	▲ 46,500		▲ 58,200		▲ 22,000	
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						
国債買入	4,700		4,500			
CP等買入		▲ 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	100		100			
国債補完供給						
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	▲ 41,900		▲ 53,600		▲ 22,000	
当座預金残高	4,532,600		4,479,000		4,457,000	
準備預金残高	3,967,000					
積み終了先	3,966,800		8月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,966,800		積数		700	
非準備預金先	565,600		1日平均		100	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,473,200	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	61.29%		

●2020年8月3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▲0.025～▲0.015%の出合いが中心となった。積み期後半を迎え、引き続き調達ニーズは強く、堅調な地合いとなった。一巡後は▲0.025%近辺で調整の出合いが見られた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.02～▲0.015%近辺での出合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/N(8/4-8/5)は、▲0.07～▲0.06%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2Y402～414、5Y136～144、10Y335～359、20Y167～172、30Y59～66、40Y9～13等にビッグの出入りがあった。

＜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▲0.082～▲0.081%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は、発行総額・償還総額ともに700億円弱の規模。商社からの発行が見られた程度で案件数は少なかった。発行レートに特段の変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2020/8/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.065	0.020	0.010	22,195.38	485.38	105.85-87	105.89-90
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.071						
2W	▲ 0.022	0.000	▲ 0.014				-	▲ 0.076						
3W							-	▲ 0.081						
1M	▲ 0.030	0.200	0.012				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.079	▲ 0.101						
6M							▲ 0.165	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.187	▲ 0.181						
									日付	7/27	7/28	7/29	7/30	7/31
									日銀当預残	4,509,000	4,515,500	4,545,800	4,559,000	4,574,500
									準備預金残	3,914,700	3,924,100	3,949,600	3,944,900	3,943,900
									マネタリーベース	5,698,300	5,704,000	5,734,500	5,747,900	5,763,100
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.026%	▲0.023%	▲0.020%	▲0.021%
									コール市場残高	108,751	110,519	108,342	110,911	120,246
									うち無担	90,836	92,559	91,784	92,669	102,992
									うちO/N	58,573	60,196	59,711	60,346	72,104
									うち有担	17,915	17,960	16,558	18,322	17,254

●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)	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	2020/8/4			11,507	4,210	0.008		0.008	78.9
国債買入(物価連動債)	300	2020/8/4			1,448	305	▲0.200		▲0.208	73.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/3	2020/8/4	▲0.350	3	3		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/3	2020/8/4	▲0.350	0	0				

●2020年8月4日の予定

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(26,000億円、8/5発行)
*7月の都区部消費者物価指数(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.2%)		
*7月のマネタリーベース		

◆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