

Central Daily Market Report

2020年8月4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8月4日		2020年8月5日		2020年8月6日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		500		0	
財政	▲ 58,600		▲ 25,900		2,000	
資金過不足	▲ 58,100		▲ 25,400		2,000	
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	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	▲ 600			600		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 1,700			
当預増減	▲ 54,100		▲ 6,600		2,000	
当座預金残高	4,478,500		4,471,900		4,473,900	
準備預金残高	3,901,700					
積み終了先	3,901,700		8月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,901,700		積数		600	
非準備預金先	576,800		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	64.52%		

●2020年8月4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。一巡後は調整から▲0.025%程度で散発的な出合いが見られていた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.02%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(8/5-8/6)は、▲0.08~▲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、短国買入オペが前回から5,000億円減額の20,000億円でおファーされ、平均落札利回較差+0.010%、按分落札利回較差+0.008%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▲0.079~▲0.075%、6M物が▲0.155%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は200億円程度であったが、案件が多く、商社・ノンバンク等から大型発行が見られたため、発行総額は1,400億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/8/4	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.067	0.010	▲ 0.010	22,573.66	378.28	106.02-04	105.91-93
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.072						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.076						
3W							-	▲ 0.081						
1M							-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.078	▲ 0.101						
6M							▲ 0.160	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.177	▲ 0.181						
									日付	7/28	7/29	7/30	7/31	8/3
									日銀当預残	4,515,500	4,545,800	4,559,000	4,574,500	4,532,600
									準備預金残	3,924,100	3,949,600	3,944,900	3,943,900	3,963,300
									マネタリーベース	5,704,000	5,734,500	5,747,900	5,763,100	5,720,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.026%	▲ 0.023%	▲ 0.020%	▲ 0.021%	▲ 0.020%
									コール市場残高	110,519	108,342	110,911	120,246	107,130
									うち無担	92,559	91,784	92,669	102,992	88,993
									うちO/N	60,196	59,711	60,346	72,104	57,385
									うち有担	17,960	16,558	18,322	17,254	18,137

●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)
10年利付国債	359	0.10%	26,000	2020/8/5	2030/6/20	76,667.0	21,074.0	100.7700	0.0210%	61.8502%	100.8000	0.0180%	4,905.0

●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	2020/8/5			44,510	20,002	0.008		0.010	69.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/4	2020/8/5	▲ 0.350	625	625		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/4	2020/8/5	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/6	2020/8/13	0.330	3,647	3,647				
米ドル資金供給		2020/8/6	2020/10/29	0.320	370	370				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/8/5	2020/8/14		1,626	1,626		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年8月5日の予定

*8月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国6月の貿易収支 *米国7月のISM非製造業景況指数	*交付税特別会計借入 (10,000億円、8/14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