

Central Daily Market Report

2020年8月5日(水)

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5日 需給速報		2020年8月6日 需給予想		2020年8月7日 当社予想	
銀行券	400	▲ 600	▲ 1,000			
財政	▲ 26,600	1,000	▲ 6,000			
資金過不足	▲ 26,200	400	▲ 7,000			
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			6,000			
CP等買入		▲ 200	▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					3,000	
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	▲ 200	600	200			
※ドル資金供給用担保提供	▲ 1,700					2,400
当増減	▲ 7,600		6,600		▲ 1,600	
当座預金残高	4,470,900		4,477,500		4,475,900	
準備預金残高	3,901,700					
積み終了先	3,901,600					
超過準備	3,901,600					
非準備預金先	569,200					
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	99.99%	日数	67.74%		

●2020年8月5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。一巡後は調達サイドに一服感が見られ、▲0.030~▲0.025%で散発的な出合いとなった。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(8/6-8/7)は、▲0.07~▲0.05%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、6M物が▲0.160~▲0.155%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還1,300億円弱に対し、発行は1,000億円強の規模で、機械・建設等の業態から案件が見られた。発行レートに目立った変動は見られていない。

●短期金融市場関連指標

2020/8/5	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	▲ 0.022				-	▲ 0.063	0.005	▲ 0.005	22,514.85	▲ 58.81	105.62-63	105.67-68
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.061						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.018	▲ 0.015	▲ 0.017				-	▲ 0.068						
2W	▲ 0.015	▲ 0.003	▲ 0.011				-	▲ 0.074						
3W							-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.088						
3M							▲ 0.078	▲ 0.101						
6M							▲ 0.160	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.177	▲ 0.179						
									日付	7/29	7/30	7/31	8/3	8/4
									日銀当預残	4,545,800	4,559,000	4,574,500	4,532,600	4,478,500
									準備預金残	3,949,600	3,944,900	3,943,900	3,963,300	3,901,800
									マネタリーベース	5,734,500	5,747,900	5,763,100	5,720,600	5,666,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.020%	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.021%
									コール市場残高	108,342	110,911	120,246	107,130	111,842
									うち無担	91,784	92,669	102,992	88,993	92,615
									うちO/N	59,711	60,346	72,104	57,385	60,857
									うち有担	16,558	18,322	17,254	18,137	19,227

●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)
交付税特会	-	-	10,000	2020/8/14	2021/2/12	344,705.0	10,000.13		0.0000%	2.9011%		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)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均発札レート・利回較差・価格較差	貸付比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/8/6			12,185	3,507	▲0.005		▲0.005	88.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/8/6			3,943	1,211	▲0.009		▲0.008	16.2
国債買入(変動利付債)	1,000	2020/8/6			1,271	1,002	▲0.290		▲0.292	88.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/5	2020/8/6	▲ 0.350	177	177		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/5	2020/8/6	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3,000	2020/8/7			7,886	3,000	▲0.044		▲0.034	39.1

●2020年8月6日の予定

*英中銀MPC結果発表

*国庫短期証券(927回)入札
(6ヶ月、33,000億円、8/11発行)

*10Y物価連動国債入札
(2,000億円、8/7発行)

◆本資料は信頼できるとさ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