

Central Daily Market Report

2020年8月11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11日 需給速報	2020年8月12日 需給予想	2020年8月13日 当社予想
銀行券	600	600	0
財政	▲ 32,500	▲ 1,400	▲ 5,000
資金過不足	▲ 31,900	▲ 800	▲ 5,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	2,900	▲ 3,100	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	9,500		
CP等買入		▲ 300	▲ 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			▲ 100
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			300
国債補完供給	▲ 2,200		2,200
※ドル資金供給用担保提供			
当預増減	▲ 25,100	1,500	▲ 5,000
当座預金残高	4,461,600	4,463,100	4,458,100
準備預金残高	3,886,900		
積み終了先	3,886,800		8月12日以降の残り所要積立額
超過準備	3,886,800		積数
非準備預金先	574,700		1日平均
			0
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			3,491,600
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			87.10%

●2020年8月11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▲0.020~▲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▲0.025~▲0.020%程度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(8/12-8/13)は、▲0.055~▲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▲0.062~▲0.061%、6M物が▲0.125%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、約1,500億円の償還に対して、夏季休暇中の発行体が多く、発行総額は560億円であった。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

2020/8/11	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	
	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)	為替(17時)
単位：%									0.025	0.020	22,750.24	420.30	105.99-00	106.12-13
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.055						
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.055						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.021				-	▲ 0.062						
2W	▲ 0.007	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.067						
3W							-	▲ 0.073						
1M							-	▲ 0.084						
3M			0.005				▲ 0.061	▲ 0.096						
6M							▲ 0.125	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.174						
									日付	8/3	8/4	8/5	8/6	8/7
									日銀当預残	4,532,600	4,478,500	4,470,900	4,475,500	4,486,700
									準備預金残	3,963,300	3,901,800	3,901,700	3,895,800	3,894,900
									マネタリーベース	5,720,600	5,666,000	5,658,000	5,663,300	5,675,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.020%
									コール市場残高	107,130	111,842	104,403	112,232	116,989
									うち無担	88,993	92,615	85,175	92,956	97,767
									うちO/N	57,385	60,857	53,617	61,298	66,309
									うち有担	18,137	19,227	19,228	19,276	19,222

●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	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/11	2020/8/12	▲ 0.350	1,772	1,772		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/11	2020/8/12	▲ 0.350	305	305		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/8/13	2020/8/20	0.340	2,752	2,752				
米ドル資金供給		2020/8/13	2020/11/6	0.320	165	165				

●2020年8月12日の予定

*7月のマネーストック	*米国7月の財政収支 *米国7月の消費者物価指数 *英国4-6月期のGDP速報値	*流動性供給入札(5,000億円、8/13発行) *交付税特別会計借入(10,000億円、8/21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