Central Daily Market Report

2020年8月12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12日 需給速報		2020年8月13日 需給予想		2020年8月14日 当社予想	
銀行券	500		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 1,800		▲ 5,300		72,000	
資金過不足	▲ 1,300		▲ 5,800		71,000	
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			30,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 1,200		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 86,800
ＥＴＦ買入	300					
国債補完供給	▲ 800	2,200		800		
＊ドル資金供給用担保国債供給						1,700
当預増減	200		23,800		▲ 14,100	

当座預金残高	4,461,800	4,485,600	4,471,500
準備預金残高	3,881,100		
積み終了先	3,881,100		
超過準備	3,881,100		
非準備預金先	580,700		

8月13日以降の残り所要積立額	
積数	100
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	100.00%	日数 90.32%

●2020年8月12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(8/13-8/14)は、▲0.08～▲0.065%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、短国買入オペが前回から10,000億円増額の30,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差0.000%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▲0.062～▲0.059%、6M物が▲0.1225%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、330億円の償還に対して、発行はノンバンクから1件実施された。夏季休暇中の発行体が多いことから市場は閑散であった。

●短期金融市場関連指標

2020/8/12	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.019				－	▲ 0.064
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.072
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.068
2W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.022				－	▲ 0.071
3W			▲ 0.015				－	▲ 0.075
1M							－	▲ 0.083
3M							▲ 0.062	▲ 0.094
6M							▲ 0.132	▲ 0.149
1Y							▲ 0.155	▲ 0.174

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.038	0.013	22,843.96	93.72	106.48-50	106.78-80

日付	8/4	8/5	8/6	8/7	8/11
日銀当預残	4,478,500	4,470,900	4,475,500	4,486,700	4,461,600
準備預金残	3,901,800	3,901,700	3,895,800	3,894,900	3,886,900
マネタリーベース	5,666,000	5,658,000	5,663,300	5,675,000	5,649,300
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.022%	▲0.022%	▲0.020%	▲0.020%
コール市場残高	111,842	104,403	112,232	116,989	113,219
うち無担	92,615	85,175	92,956	97,767	93,538
うちO/N	60,857	53,617	61,298	66,309	63,690
うち有担	19,227	19,228	19,276	19,222	19,681

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
流動性供給	315	－	5,000	2020/8/13		10,106.0	4,990.0		0.0140%	69.6113%		0.0090%	
交付税特会	－	－	10,000	2020/8/21	2021/2/18	323,202.0	10,000.11		0.0000%	3.0941%		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	30,000	2020/8/13			68,247	30,004	0.000		0.006	85.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/8/12	2020/8/13	▲ 0.350	538	538		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/8/12	2020/8/13	▲ 0.350	268	268		▲0.350	▲0.350	

●2020年8月13日の予定

＊7月の企業物価指数

◆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。
◆本資料は何ら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論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