

Central Daily Market Report

2020年8月13日(木)

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13日		2020年8月14日		2020年8月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		100		0	
財政	▲ 6,800		76,200		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 7,200		76,300		▲ 13,000	
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			12,100			
CP等買入		▲ 1,200		▲ 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			49,400	▲ 86,800		
E T F 買入			200			
国債補充供給	▲ 300	800		300		
米ドル資金供給用担保提供供給				1,700		
当増減	22,100		53,000		▲ 13,000	
当座預金残高	4,483,900		4,536,900		4,523,900	
準備預金残高	3,891,100					
積み終了先	3,891,100				8月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,891,100				積数	100
非準備預金先	592,800				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		93.55%

●2020年8月13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。積み期最終日が近いことから、一部取り上がる先がみられていた。一巡後は調達サイドに一服感が見られ▲0.025~▲0.020%程度で散發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>

GCT/N(8/14-8/17)は、▲0.09~▲0.08%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、30Y59~67、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▲0.065%、6M物が▲0.135%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、約1,700億の償還に対して、石油業態からまとまった調達が実施されたものの件数が少なく550億円程度の発行にとどまった。発行レートは概ね同水準で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/8/13	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.089	0.030	▲ 0.008	23,249.61	405.65	106.83-85	106.63-65
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.081						
2W							-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.081						
1M	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.086						
3M			0.025				▲ 0.066	▲ 0.097						
6M							▲ 0.140	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.173						
									日付	8/5	8/6	8/7	8/11	8/12
									日銀当預残	4,470,900	4,475,500	4,486,700	4,461,600	4,461,800
									準備預金残	3,901,700	3,895,800	3,894,900	3,886,900	3,881,100
									マネタリーベース	5,658,000	5,663,300	5,675,000	5,649,300	5,649,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.022%	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.019%
									コール市場残高	104,403	112,232	116,989	113,219	117,115
									うち無担	85,175	92,956	97,767	93,538	97,350
									うちO/N	53,617	61,298	66,309	63,690	67,402
									うち有担	19,228	19,276	19,222	19,681	19,765

●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)	募入最低値	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)
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)	発札総額(億円・百万ドル)	競付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均発札レート・利回差・価格差	競付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/8/14			10,134	4,204	▲0.005		▲0.005	76.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/8/14			9,604	3,507	▲0.005		▲0.005	61.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/8/14			6,181	4,204	▲0.012		▲0.008	76.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/13	2020/8/14	▲ 0.350	311	311		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/13	2020/8/14	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/17	2020/8/24	0.340	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2020/8/14	2021/2/26	0	49,410

●2020年8月14日の予定

*6月の第3次産業活動指数	*米国6月の企業在庫	*米国7月の小売売上高	*国庫短期証券(929回)入札(3ヶ月、75,500億円、8/17発行)
	*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率	*米国8月のシガン大消費者信頼感指数速報	*流動性供給入札(5,000億円、8/17発行)
	*米国8月のシガン大消費者信頼感指数速報	*ユーロ圏4-6月期のGDP2次速報	*国有林野借入(963億円、8/25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