

●資金需給

単位：億円	2020年8月14日	2020年8月17日	2020年8月18日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	200	800	0
財政	77,100	▲ 18,500	4,000
資金過不足	77,300	▲ 17,700	4,000
金融調節	スタート	スタート	スタート
	エンド	エンド	エンド
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	12,100		
CP等買入		▲ 600	
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	800	
国債補完供給	▲ 300	300	
米ドル資金供給用担保国債供給	1,700		
当預増減	53,700	▲ 17,200	4,000
当座預金残高	4,537,600	4,520,400	4,524,400
準備預金残高	3,933,200		
積み終了先	3,933,200		8月17日以降の残り所要積立額
超過準備	3,933,200		積数
非準備預金先	604,400		1日平均
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			3,499,200
準備預金進捗率	実績	82.02%	日数
			3.23%

●2020年8月14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▲0.035～▲0.015%の出合いが中心となった。年金定時払い及び新積み期に跨る取引にあたることから、一部ビッド水準を引き下げる先がみられた。一巡後は調達サイドに一服感が見られ▲0.035～▲0.030%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。

＜レポート市場＞

GC T/N(8/17-8/18)は、▲0.07～▲0.06%程度での出会い。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等にビッドの出入りがあった。

＜短国市場＞

本日はTB3M物(929回)の入札が実施された。WI取引において▲0.071～▲0.068%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0701%、按分落札利回▲0.0661%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.086～▲0.075%と、堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP市場は、400億円強の償還額に対して、500億円前後の調達が数件実施されたことで発行総額は2,000億円程度となった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/8/14	無担 (遠報)			有担 (遠報)			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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.024				-	▲ 0.076
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.070
S/N							-	-
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.071
2W	▲ 0.027	▲ 0.007	▲ 0.021				-	▲ 0.073
3W							-	▲ 0.078
1M	▲ 0.025	0.025	▲ 0.008				-	▲ 0.083
3M							▲ 0.089	▲ 0.095
6M							▲ 0.145	▲ 0.149
1Y							▲ 0.155	▲ 0.173

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)
0.045	0.015	23,289.36	39.75	106.98-99	106.75-76

日付	8/6	8/7	8/11	8/12	8/13
日銀当預残	4,475,500	4,486,700	4,461,600	4,461,800	4,483,900
準備預金残	3,895,800	3,894,900	3,886,900	3,881,100	3,891,100
マネタリーベース	5,663,300	5,675,000	5,649,300	5,649,000	5,671,500
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.019%	▲0.016%
コールド市場残高	112,232	116,989	113,219	117,115	112,361
うち無担	92,956	97,767	93,538	97,350	93,560
うちO/N	61,298	66,309	63,690	67,402	64,542
うち有担	19,276	19,222	19,681	19,765	18,801

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非償価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	929	-	75,500	2020/8/17	2020/11/16	203,167.0	61,699.1	100.0165	▲0.0661%	61.3928%	100.0175	▲0.0701%	13,800.0
流動性供給	316	-	5,000	2020/8/17		16,640.0	4,989.0		0.0110%	46.9656%		0.0080%	
国有林野借入	-	-	963	2020/8/25	2025/8/25	3,390.0	963.00		0.0000%	50.0000%		0.0000%	

●オペ結果

種類	オフアー額 (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(午前オフアー分)		2020/8/14	2020/8/17	▲ 0.350	271	271		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフアー分)		2020/8/14	2020/8/17	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/18	2020/8/25	0.340	0	0				

●2020年8月17日の予定

*4-6月期のGDP1次速報
市場予想：前期比年率▲27.2%

◆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。