

Central Daily Market Report

2020年8月17日(月)
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17日		2020年8月18日		2020年8月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		1,200		0	
財政	▲ 20,400		▲ 1,400		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 19,500		▲ 200		▲ 6,000	
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	800					
国債補完供給	▲ 400	300		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 19,400		100		▲ 6,000	
当座預金残高	4,518,200		4,518,300		4,512,300	
準備預金残高	3,936,300					
積み終了先	3,851,900		8月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,364,500		積数		57,500	
非準備預金先	581,900		1日平均		2,000	
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	98.36%	日数	6.45%		

●2020年8月17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▲0.080~▲0.030%の出合いとなった。新積み期入りしたことで、調達姿勢は全般的に後退し、立ち上がりは▲0.060~▲0.040%が中心となり、一巡後は調整から▲0.080~▲0.070%の出合いとなった。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(8/18-8/19)は、▲0.075~▲0.070%程度での出合い。SCはローラー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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.090~▲0.088%で出合った。

<CP市場>

発行市場は償還が無く、発行総額は450億円程度まで膨らんだものの、案件は少なく閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/8/17	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.071	0.040	▲ 0.005	23,096.75	▲ 192.61	106.56-57	106.48-49
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W			0.000				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.074						
3W							-	▲ 0.078						
1M	▲ 0.029	▲ 0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.084						
3M							▲ 0.089	▲ 0.094						
6M							▲ 0.138	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.172						
									日付	8/7	8/11	8/12	8/13	8/14
									日銀当預残	4,486,700	4,461,600	4,461,800	4,483,900	4,537,600
									準備預金残	3,894,900	3,886,900	3,881,100	3,891,100	3,933,200
									マネタリーベース	5,675,000	5,649,300	5,649,000	5,671,500	5,725,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.016%	▲ 0.024%
									コール市場残高	116,989	113,219	117,115	112,361	108,041
									うち無担	97,767	93,538	97,350	93,560	90,819
									うちO/N	66,309	63,690	67,402	64,542	62,731
									うち有担	19,222	19,681	19,765	18,801	17,222

●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	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)	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)		2020/8/17	2020/8/18	▲ 0.350	318	318		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/17	2020/8/18	▲ 0.350	0	0				

●2020年8月18日の予定

*米国7月の住宅着工件数

*30年利付国債入札(9,000億円、8/19発行)

◆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