

# Central Daily Market Report

2020年8月18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18日		2020年8月19日		2020年8月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,200		0		▲ 1,000	
財政	100		▲ 8,900		▲ 10,000	
資金過不足	1,300		▲ 8,900		▲ 11,000	
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			25,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
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			900			
国債補完供給		400				
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	1,600		16,700		▲ 11,000	
当座預金残高	4,519,800		4,536,500		4,525,500	
準備預金残高	3,950,600					
積み終了先	3,926,200		8月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,913,700		積数	20,600		
非準備預金先	569,200		1日平均	700		
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	99.41%	日数	9.68%		

## ●2020年8月18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。立ち上がりは▲0.055~▲0.040%とややしっかりした展開となった。また、地銀業態からの試し取りで+0.001%の出合いも見られた。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(8/19-8/20)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>

本日は短国買入オベが25,000億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.005%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▲0.092~▲0.085%、6M物が▲0.140%で出合った。

### <CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超であった。一部の卸売・機械業態において大型発行があったものの、その他は小型案件であったため落ち着いたマーケットであった。発行レートは概ね横ばいで推移した。本日はCP等買入オベが6,000億円でオファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.017%・全取レート▲0.058%と、前回(平均▲0.002%・按分▲0.005%)比で大きく低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/8/18	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.045				-	▲ 0.075	0.035	▲ 0.005	23,051.08	▲ 45.67	106.00-01	105.52-54
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.080						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.073						
2W	▲ 0.030	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.074						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.080						
1M	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.084						
3M							▲ 0.093	▲ 0.094						
6M							▲ 0.142	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.172						
									日付	8/11	8/12	8/13	8/14	8/17
									日銀当預残	4,461,600	4,461,800	4,483,900	4,537,600	4,518,200
									準備預金残	3,886,900	3,881,100	3,891,100	3,933,200	3,936,300
									マネタリーベース	5,649,300	5,649,000	5,671,500	5,725,100	5,704,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.016%	▲ 0.024%	▲ 0.052%
									コール市場残高	113,219	117,115	112,361	108,041	107,748
									うち無担	93,538	97,350	93,560	90,819	89,152
									うちO/N	63,690	67,402	64,542	62,731	61,914
									うち有担	19,681	19,765	18,801	17,222	18,596

## ●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1非価格競争入札(億円)
30年利付国債	67	0.60%	9,000	2020/8/19	2050/6/20	25,154.0	7,302.0	99.3500	0.6250%	26.1213%	99.5700	0.6170%	1,692.0

## ●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	全取レート・利回較差	平均落札レート・利回較差	按分比率
国庫短期証券買入	25,000	2020/8/19			41,498	25,001	0.005		0.006	98.7
CP等買入	6,000	2020/8/20			5,452	5,392		▲ 0.058	▲ 0.017	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/18	2020/8/19	▲ 0.350	20	20		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/18	2020/8/19	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/20	2020/8/27	0.340	1,523	1,523				
米ドル資金供給		2020/8/20	2020/11/13	0.330	405	405				

## ●2020年8月19日の予定

*6月の機械受注統計 (市場予想:電力除く民需、前月比+2.0%)	*英国7月の消費者物価指数	*国庫短期証券(930回)入札 (1年、35,000億円、8/20発行)
*6月の石油等消費動態統計	*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値	
*7月の貿易統計		

◆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