

Central Daily Market Report

2020年8月19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19日		2020年8月20日		2020年8月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	0		▲ 200		▲ 1,000	
財政	▲ 9,800		▲ 23,700		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 9,800		▲ 23,900		▲ 17,000	
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			8,100			
CP等買入		▲ 300	5,400	▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					2,000	▲ 900
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	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保提供供給						900
当増減	15,600		▲ 10,600		▲ 15,000	
当座預金残高	4,535,400		4,524,800		4,509,800	
準備預金残高	3,958,500					
積み終了先	3,954,600		8月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,948,300		積数		10,400	
非準備預金先	576,900		1日平均		400	
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	99.70%	日数	12.90%		

●2020年8月19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▲0.075~▲0.025%の出合いとなった。▲0.045%で寄り付いた後は、オファー確保の動きが先行し▲0.045~▲0.025%のレンジで推移した。出合い一巡後は▲0.055~▲0.050%で調整の出合い。また、試し取りが行われたことで+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(8/20-8/21)は、▲0.075~▲0.065%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TB1Y物(930回)の入札が実施された。WI取引において▲0.151~▲0.144%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1417%、按分落札利回▲0.1308%と、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.136~▲0.133%出合いと堅調な推移となった。この他に、3M物が▲0.098~▲0.095%、6M物が▲0.145~▲0.144%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600億円程度に対して、発行総額は1,100億円程度と発行超であった。卸売業態の一部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。

●短期金融市場関連指標

2020/8/19	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.068	0.025	▲ 0.010	23,110.61	59.53	105.24-25	105.42-43
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.018				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.018				-	▲ 0.074						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.083						
3M							▲ 0.097	▲ 0.094						
6M							▲ 0.143	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.172						
									日付	8/12	8/13	8/14	8/17	8/18
									日銀当預残	4,461,800	4,483,900	4,537,600	4,518,200	4,519,800
									準備預金残	3,881,100	3,891,100	3,933,200	3,936,300	3,950,600
									マネタリーベース	5,649,000	5,671,500	5,725,100	5,704,800	5,705,100
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.016%	▲0.024%	▲0.052%	▲0.045%
									コール市場残高	117,115	112,361	108,041	107,748	111,649
									うち無担	97,350	93,560	90,819	89,152	93,371
									うちO/N	67,402	64,542	62,731	61,914	66,113
									うち有担	19,765	18,801	17,222	18,596	18,278

●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)
国庫短期証券	930	-	35,000	2020/8/20	2021/8/20	84,217.0	28,956.7	100.1310	▲0.1308%	18.1818%	100.1420	▲0.1417%	6,043.0

●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・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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/8/20			10,957	3,506	0.005		0.006	12.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/8/20			6,838	4,209	0.001		0.003	50.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/19	2020/8/20	▲ 0.350	161	161		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/19	2020/8/20	▲ 0.350	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)
被災地金融支援オペ	第2回	2020/8/21		1,982

●2020年8月20日の予定

*5年利付国債入札(25,000億円、8/21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