Central Daily Market Report

2020年8月20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20日 需給速報		2020年8月21日 需給予想		2020年8月24日 当社予想	
銀行券	▲ 200		0		0	
財政	▲ 23,400		▲ 12,700		▲ 16,000	
資金過不足	▲ 23,600		▲ 12,700		▲ 16,000	
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						▲ 2,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	8,100					
CP等買入	5,400	▲ 400		▲ 300		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 600	200		600		
※ドル資金供給用担保国債供給				1,000		
当預増減	▲ 10,900		▲ 10,300		▲ 18,900	

当座預金残高	4,524,500	4,514,200	4,495,300
準備預金残高	3,932,000		
積み終了先	3,930,300	8月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,929,300	積数	7,600
非準備預金先	592,500	1日平均	300
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 99.78%	日数	16.13%

●2020年8月20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。▲0.040%で寄り付いた後は▲0.045～▲0.030%でまとまった出合いが見られ、一巡後に調整から▲0.075%が出合った程度であった。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(8/21-8/24)は、▲0.080～▲0.070%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▲0.100%、1Y物が▲0.136～▲0.135%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は鉄鋼業態においてまとまった発行が実施された。償還総額200億円程度に対して、発行総額は350億円程度と発行超であった。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

2020/8/20	無担（速報）			有担（速報）			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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.039				－	▲ 0.068
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.074
S/N							－	－
1W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.030				－	▲ 0.073
2W			▲ 0.005				－	▲ 0.075
3W							－	▲ 0.078
1M	▲ 0.035	▲ 0.032	▲ 0.033				－	▲ 0.083
3M							▲ 0.100	▲ 0.093
6M							▲ 0.143	▲ 0.142
1Y							▲ 0.136	▲ 0.171

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）
0.025	0.000	22,880.62	▲ 229.99	106.07-08	106.02-03

日付	8/13	8/14	8/17	8/18	8/19
日銀当預残	4,483,900	4,537,600	4,518,200	4,519,800	4,535,400
準備預金残	3,891,100	3,933,200	3,936,300	3,950,600	3,958,600
マネタリーベース	5,671,500	5,725,100	5,704,800	5,705,100	5,720,700
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.024%	▲0.052%	▲0.045%	▲0.040%
コール市場残高	112,361	108,041	107,748	111,649	123,372
うち無担	93,560	90,819	89,152	93,371	104,804
うちO/N	64,542	62,731	61,914	66,113	75,716
うち有担	18,801	17,222	18,596	18,278	18,568

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
5年利付国債	144	0.10%	25,000	2020/8/21	2025/6/20	72,365.0	20,369.00	100.9300	▲0.0910%	99.4049%	100.9400	▲0.0930%	4,613.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/8/20	2020/8/21	▲ 0.350	251	251		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/8/20	2020/8/21	▲ 0.350	283	283		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/8/24	2020/8/31	0.340	0	0				

●2020年8月21日の予定

*7月の全国消費者物価指数(CPI)
（市場予想：前年同月比（除く生鮮）＋0.1%）

*米国7月の中古住宅販売

*国庫短期証券（931回）入札
（3ヶ月、75,500億円、8/24発行）
*交付税特別会計借入
（10,000億円、8/31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。
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