

# Central Daily Market Report

2020年8月21日(金)  
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21日		2020年8月24日		2020年8月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		300			0
財政	▲ 12,700		▲ 12,200			▲ 32,000
資金過不足	▲ 12,800		▲ 11,900			▲ 32,000
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			2,800	▲ 2,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,800			
CP等買入		▲ 300		▲ 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						2,000
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			300			
国債補完供給	▲ 100	600		100		
※ドル資金供給用担保提供		1,000				
当増減	▲ 10,500		▲ 3,100			▲ 30,000
当座預金残高	4,514,000		4,510,900			4,480,900
準備預金残高	3,917,900					
積み終了先	3,917,400		8月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,916,800		積数	4,400		
非準備預金先	596,100		1日平均	200		
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	99.87%	日数	25.81%		

## ●2020年8月21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。▲0.035%で寄り付いた後は▲0.055～▲0.025%で推移し、一巡後は調整から▲0.075～▲0.045%の出合いが見られた。固定金利方式による共通担保資金供給オペは2W物が2兆円オファーされ、結果は2,802億円(期落ち分2,851億円)と未達であった。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＞

GC T/N(8/24-8/25)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TB3M物(931回)の入札が実施された。WI取引において▲0.085～▲0.080%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0829%、按分落札利回▲0.0753%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、▲0.089～▲0.084%と、堅調に推移した。この他、1Y物が▲0.140～▲0.130%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1,200億円程度に対して、発行総額は1,500億円程度と発行超であった。一部の紙・パルプ業態において大型発行があり案件数は膨らんだものの、小型案件が中心となる比較的落ち着いたマーケットであった。発行レートは低水準で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/8/21	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	▲ 0.037				-	▲ 0.071	0.030	0.005	22,920.30	39.68	105.67-68	105.51-52
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.070						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.071						
2W	▲ 0.033	0.010	▲ 0.010				-	▲ 0.073						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.077						
1M	▲ 0.032	0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.082						
3M							▲ 0.088	▲ 0.093						
6M							▲ 0.141	▲ 0.142						
1Y							▲ 0.134	▲ 0.171						
									日付	8/14	8/17	8/18	8/19	8/20
									日銀当預残	4,537,600	4,518,200	4,519,800	4,535,400	4,524,500
									準備預金残	3,933,200	3,936,300	3,950,600	3,958,600	3,932,000
									マネタリーベース	5,725,100	5,704,800	5,705,100	5,720,700	5,710,000
									無担O/N加重平均	▲0.024%	▲0.052%	▲0.045%	▲0.040%	▲0.039%
									コール市場残高	108,041	107,748	111,649	123,372	112,368
									うち無担	90,819	89,152	93,371	104,804	94,010
									うちO/N	62,731	61,914	66,113	75,716	64,007
									うち有担	17,222	18,596	18,278	18,568	18,358

## ●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	931	-	75,500	2020/8/24	2020/11/24	170,033.9	61,564.50	100.0190	▲0.0753%	90.8243%	100.0209	▲0.0829%	13,935.0
交付税特会	-	-	10,000	2020/8/31	2021/3/2	301,713.0	10,000.21		0.0000%	3.3145%		0.0000%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2020/8/24	2020/9/7		2,802	2,802				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/8/24			12,742	4,205	0.003		0.003	62.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/8/24			9,928	4,205	▲0.004		▲0.002	34.3
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/8/24			1,527	306	0.004		0.004	44.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/21	2020/8/24	▲0.350	111	111		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/21	2020/8/24	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/8/25	2020/9/1	0.340	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/8/25			4,716	2,000	0.165		0.181	1.9

## ●2020年8月24日の予定

\*国庫短期証券(932回)入札(6ヶ月、34,000億円、8/25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