

# Central Daily Market Report

2020年8月24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24日 需給速報	2020年8月25日 需給予想	2020年8月26日 当社予想
銀行券	200	500	0
財政	▲ 17,100	▲ 31,100	▲ 14,000
資金過不足	▲ 16,900	▲ 30,600	▲ 14,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
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	4,500	
CP等買入		▲ 300	▲ 400
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		2,000	▲ 100
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	▲ 200	100	200
※ドル資金供給用担保提供			
当預増減	▲ 8,300	▲ 24,400	▲ 14,000
当座預金残高	4,505,700	4,481,300	4,467,300
準備預金残高	3,936,400		
積み終了先	3,935,900		8月25日以降の残り所要積立額
超過準備	3,935,900		積数
非準備預金先	569,300		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	99.89%	日数
			29.03%

## ●2020年8月24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▲0.065～▲0.030%の出合いとなった。▲0.055～▲0.030%と概ね横ばい圏のレンジで推移し、一巡後は調整から▲0.065%の出合いが見られた。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(8/25-8/26)は、▲0.070～▲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2Y402～415、5Y136～144、10Y335～359、20Y167～173、30Y59～67、40Y9～13等にビッドの出入りがあった。

### ＜短国市場＞

本日はTB6M物(932回)の入札が実施された。WI取引において▲0.133～▲0.118%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1110%、按分落札利回▲0.1011%と、弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.110%での出合いが見られた。この他、3M物が▲0.090～▲0.087%、1Y物が▲0.140～▲0.120%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は電気機器業態において大型発行が実施された。償還総額400億円程度に対して、発行総額は1,200億円程度と発行超であった。発行レートはマイナス圏のままで、概ね前日比横ばいの動きであった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/8/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.041					-	▲ 0.069	0.020	▲ 0.010	22,985.51	65.21	105.87-88	105.85-87
T/N			▲ 0.001					-	▲ 0.067						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.038	0.000	▲ 0.030					-	▲ 0.070						
2W	▲ 0.030	0.180	▲ 0.011					-	▲ 0.073						
3W			0.040					-	▲ 0.077						
1M			▲ 0.040					-	▲ 0.083						
3M								▲ 0.090	▲ 0.091						
6M								▲ 0.110	▲ 0.139						
1Y								▲ 0.129	▲ 0.171						
										日付	8/17	8/18	8/19	8/20	8/21
										日銀当預残	4,518,200	4,519,800	4,535,400	4,524,500	4,514,000
										準備預金残	3,936,300	3,950,600	3,958,600	3,932,000	3,917,900
										マネタリーベース	5,704,800	5,705,100	5,720,700	5,710,000	5,699,600
										無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.045%	▲0.040%	▲0.039%	▲0.037%
										コール市場残高	107,748	111,649	123,372	112,368	113,181
										うち無担	89,152	93,371	104,804	94,010	95,007
										うちO/N	61,914	66,113	75,716	64,007	64,959
										うち有担	18,596	18,278	18,568	18,358	18,174

## ●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	932	-	34,000	2020/8/25	2021/2/25	91,317.0	28,528.7	100.0510	▲0.1011%	6.5127%	100.0560	▲0.1110%	5,471.0

## ●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1年以下)	1,000	2020/8/25			2,237	1,002	0.009		0.011	34.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/8/25			8,980	3,507	▲0.008		▲0.006	26.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/24	2020/8/25	▲ 0.350	173	173		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/24	2020/8/25	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年8月25日の予定

*米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*20年利付国債入札(12,000億円、8/26発行)	*交付税特別会計借入(10,000億円、9/2借入)
*米国7月の新築一戸建て販売件数		
*米国8月のCB消費者信頼感指数		

◆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。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録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