

Central Daily Market Report

2020年8月25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25日		2020年8月26日		2020年8月27日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 300		0	
財政	▲ 30,600		▲ 5,600		1,000	
資金過不足	▲ 30,300		▲ 5,900		1,000	
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						
国債買入	4,500					
CP等買入		▲ 400		▲ 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	2,000	▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 17,300
E T F買入						
国債補完供給		200				
*米ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 24,100		▲ 6,200		▲ 16,300	
当座預金残高	4,481,600		4,475,400		4,459,100	
準備預金残高	3,898,900					
積み終了先	3,898,500				8月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,898,500				積数	3,500
非準備預金先	582,700				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	99.90%	日数	32.26%		

●2020年8月25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▲0.050～▲0.030%中心で、一巡後はビッドが薄くなり、調整から▲0.080～▲0.060%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(8/26-8/27)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＞

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.093～▲0.091%、6M物が▲0.113%、1Y物が▲0.129～▲0.128%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は陸運業態において大型発行が実施された。償還総額150億円程度に対して、発行総額は2,100億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

2020/8/25	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.048				-	▲ 0.069	0.029	0.009	23,296.77	311.26	106.00-01	106.18-20
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.067						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.032				-	▲ 0.070						
2W	▲ 0.035	0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.073						
3W			0.020				-	▲ 0.077						
1M			▲ 0.037				-	▲ 0.082						
3M			0.030				▲ 0.093	▲ 0.091						
6M							▲ 0.112	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.168						
									日付	8/18	8/19	8/20	8/21	8/24
									日銀当預残	4,519,800	4,535,400	4,524,500	4,514,000	4,505,700
									準備預金残	3,950,600	3,958,600	3,932,000	3,917,900	3,936,400
									マネタリーベース	5,705,100	5,720,700	5,710,000	5,699,600	5,691,100
									無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.040%	▲0.039%	▲0.037%	▲0.041%
									コール市場残高	111,649	123,372	112,368	113,181	113,036
									うち無担	93,371	104,804	94,010	95,007	93,708
									うちO/N	66,113	75,716	64,007	64,959	61,280
									うち有担	18,278	18,568	18,358	18,174	19,328

●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)
20年利付国債	173	0.40%	12,000	2020/8/26	2040/6/20	38,370.0	9,789.0	99.9000	0.4050%	67.8187%	99.9400	0.4030%	2,203.0
交付税特会	-	-	10,000	2020/9/2	2021/3/5	293,350.0	10,000.24		0.0000%	3.4090%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/25	2020/8/26	▲ 0.350	33	33		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/25	2020/8/26	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/27	2020/9/3	0.340	673	673				
米ドル資金供給		2020/8/27	2020/11/19	0.320	171	171				

●2020年8月26日の予定

*6月の景気動向指数改訂状況	*米国7月の耐久財新規受注
*7月の企業向けサービス価格指数	

◆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書等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