

Central Daily Market Report

2020年8月26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26日		2020年8月27日		2020年8月28日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 800		▲ 1,000	
財政	▲ 4,000		400		6,000	
資金過不足	▲ 4,400		▲ 400		5,000	
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			30,000			
国債買入			12,200			
CP等買入		▲ 300		▲ 300	6,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)				▲ 100		
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別			133,500	▲ 17,300		
E T F買入			400			
国債補完供給						900
当預増減	▲ 4,700		157,800		11,900	
当座預金残高	4,476,900		4,634,700		4,646,600	
準備預金残高	3,890,700					
積み終了先	3,890,300				8月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,890,300				積数	3,100
非準備預金先	586,200				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	99.91%	日数	35.48%		

●2020年8月26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。取り手の様子見姿勢から▲0.055~▲0.040%でまとまった出合いが見られた後は、▲0.075~▲0.060%で調整の出合いとなった。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(8/27-8/28)は、▲0.085~▲0.070%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、短国買入オベが30,000億円度でオファーされた。平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.003%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.092%、6M物が▲0.114~▲0.112%、1Y物が▲0.131~▲0.130%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は電気・ガス業態においてまとまった発行が実施された。償還総額1,000億円程度に対して、発行総額は850億円程度と償還超であった。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。本日はCP等買入オベが6,000億円度でオファーされた。入札結果は平均落札レート▲0.023%・按分レート▲0.028%と、前回(平均▲0.017%・全取▲0.058%)比で平均は低下し、按分は上昇した。

●短期金融市場関連指標

2020/8/26	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.076	0.040	0.011	23,290.86	▲ 5.91	106.39-41	106.30-31
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.074						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.075						
3W			▲ 0.045				-	▲ 0.078						
1M							-	▲ 0.082						
3M							▲ 0.093	▲ 0.091						
6M							▲ 0.114	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.131	▲ 0.167						
									日付	8/19	8/20	8/21	8/24	8/25
									日銀当預残	4,535,400	4,524,500	4,514,000	4,505,700	4,481,600
									準備預金残	3,958,600	3,932,000	3,917,900	3,936,400	3,898,900
									マネタリーベース	5,720,700	5,710,000	5,699,600	5,691,100	5,666,700
									無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.039%	▲0.037%	▲0.041%	▲0.048%
									コール市場残高	123,372	112,368	113,181	113,036	114,441
									うち無担	104,804	94,010	95,007	93,708	95,693
									うちO/N	75,716	64,007	64,959	61,280	62,515
									うち有担	18,568	18,358	18,174	19,328	18,748

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国庫短期証券買入	30,000	2020/8/27			73,200	30,000	0.003		0.006	2.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/8/27			8,265	4,203	▲0.005		0.002	53.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/8/27			10,201	3,505	0.007		0.008	5.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/8/27			10,778	4,206	0.009		0.011	39.6
CP等買入	6,000	2020/8/28			9,802	5,977	▲0.028		▲0.023	56.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/26	2020/8/27	▲0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/26	2020/8/27	▲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)	(参考)2020/8/27時点の貸出残高(億円)					
新型コロナ対応金融支援特別	2020/8/27	2021/2/26	0	133,538	350,169					

●2020年8月27日の予定

*月例経済報告	*米国4-6月期のGDP改定値	*2年利付国債入札(30,000億円、9/1発行)
		*交付税特別会計借入(10,000億円、9/4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