

Central Daily Market Report

2020年8月27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27日		2020年8月28日		2020年8月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 300			500
財政	1,400		5,600			4,300
資金過不足	600		5,300		4,800	
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	6,000	▲ 400		
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		500			
国債補完供給				1,000		
米ドル資金供給用担保提供						
当増減	158,800		12,400		4,800	
当座預金残高	4,635,700		4,648,100		4,652,900	
準備預金残高	4,029,800					
積み終了先	4,029,500		8月28日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,028,900		積数		2,200	
非準備預金先	605,900		1日平均		100	
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	99.94%	日数	38.71%		

●2020年8月27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～▲0.035%の出合いとなった。▲0.060～▲0.040%のレンジでまとまって出合った後、調整から▲0.080～▲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(8/28-8/31)は、▲0.090～▲0.080%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、6M物が▲0.116～▲0.115%、1Y物が▲0.136～▲0.135%で出合った。

＜CP市場＞

本日のCP発行市場は月末発行にあたり、食料品、鉄鋼、電気機器等幅広い業態において大型発行が実施され活況なマーケットとなった。償還総額8,500億円程度に対して、発行総額は5,000億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、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

2020/8/27	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	▲ 0.054				-	▲ 0.077	0.040	0.000	23,208.86	▲ 82.00	105.86-88	106.00-02
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.084						
S/N	▲ 0.120	▲ 0.080	▲ 0.106				-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.080						
2W							-	▲ 0.078						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.079						
1M							-	▲ 0.086						
3M							▲ 0.093	▲ 0.092						
6M							▲ 0.117	▲ 0.136						
1Y							▲ 0.135	▲ 0.167						
									日付	8/20	8/21	8/24	8/25	8/26
									日銀当預残	4,524,500	4,514,000	4,505,700	4,481,600	4,476,900
									準備預金残	3,932,000	3,917,900	3,936,400	3,898,900	3,890,700
									マネタリーベース	5,710,000	5,699,600	5,691,100	5,666,700	5,662,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.037%	▲ 0.041%	▲ 0.048%	▲ 0.051%
									コール市場残高	112,368	113,181	113,036	114,441	111,542
									うち無担	94,010	95,007	93,708	95,693	92,953
									うちO/N	64,007	64,959	61,280	62,515	59,475
									うち有担	18,358	18,174	19,328	18,748	18,589

●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)
2年利付国債	416	0.10%	30,000	2020/9/1	2022/9/1	114,038.0	24,449.0	100.4300	▲0.1140%	71.0546%	100.4330	▲0.1150%	5,534.0
交付税特会	-	-	10,000	2020/9/4	2021/3/9	280,368.0	10,000.08		0.0000%	3.5668%		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)		2020/8/27	2020/8/28	▲ 0.350	7	7		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/27	2020/8/28	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/31	2020/9/8	0.340	0	0				

●2020年8月28日の予定

*8月の都区部消費者物価指数 (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.3%)	*米国7月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(933回)入札 (3ヶ月、75,500億円、8/31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