

Central Daily Market Report

2020年8月28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28日		2020年8月31日		2020年9月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		400		1,000	
財政	5,900		4,200		▲ 36,000	
資金過不足	5,600		4,600		▲ 35,000	
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			2,100			
CP等買入	6,000	▲ 400		▲ 2,900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	500					
国債補充供給						
米ドル資金供給用担保提供		1,000				
当増減	12,700		3,800		▲ 35,000	
当座預金残高	4,648,400		4,652,200		4,617,200	
準備預金残高	4,025,200					
積み終了先	4,024,700				8月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,024,700				積数	900
非準備預金先	623,200				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	99.97%	日数	48.39%		

●2020年8月28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▲0.055~▲0.040%のレンジで出合いが見られ、一巡後は▲0.080~▲0.065%の調整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(8/31-9/1)は、▲0.085~▲0.075%程度での出合い。SCはロール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TB3M物(933回)の入札が実施された。WI取引において▲0.089~▲0.085%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0898%、按分落札利回▲0.0862%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、ショートカバーからか、▲0.120~▲0.115%出合いと強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.122~▲0.120%、1Y物が▲0.136%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は機械業態において大型発行が実施された。償還総額100億円程度に対して、発行総額は650億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。

●2020年8月31日の予定

*7月の商業動態統計速報	
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+5.8%)	
*7月の住宅着工統計	*8月の消費動向調査
*米国8月のシカゴPM景況感指数	

●短期金融市場関連指標

2020/8/28	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	▲ 0.054				-	▲ 0.080	0.055	0.015	22,882.65	▲ 326.21	106.65-67	106.06-08
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.045				-	▲ 0.078						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.080						
1M	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.083						
3M							▲ 0.121	▲ 0.092						
6M							▲ 0.122	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.166						
									日付	8/21	8/24	8/25	8/26	8/27
									日銀当預残	4,514,000	4,505,700	4,481,600	4,476,900	4,635,700
									準備預金残	3,917,900	3,936,400	3,898,900	3,890,700	4,029,900
									マネタリーベース	5,699,600	5,691,100	5,666,700	5,662,400	5,822,000
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.041%	▲0.048%	▲0.051%	▲0.054%
									コール市場残高	113,181	113,036	114,441	111,542	112,035
									うち無担	95,007	93,708	95,693	92,953	92,894
									うちO/N	64,959	61,280	62,515	59,475	58,761
									うち有担	18,174	19,328	18,748	18,589	19,141

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	933	-	75,500	2020/8/31	2020/11/30	212,744.0	61,563.4	100.0215	▲0.0862%	35.1047%	100.0224	▲0.0898%	13,936.0

●オペ結果

種類	オフター價(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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/8/31			2,689	1,206	0.018		0.020	15.0
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/8/31			1,537	303	0.026		0.027	31.8
国債買入(物価連動債)	300	2020/8/31			1,854	301	▲0.100		▲0.139	36.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2020/8/28	2020/8/31	▲0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2020/8/28	2020/8/31	▲0.350	5	5		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/9/1	2020/9/8	0.340	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・百万ドル)	貸付先数					
成長基盤強化	本則第41回	2020/9/2		1,804	20					
成長基盤強化	米ドル特別第33期	2020/9/4		4,000	29					
成長基盤強化	米ドル特別第29期(借り換え)	2020/9/4		611	11					
成長基盤強化	米ドル特別第25期(借り換え)	2020/9/4		1,249	13					
成長基盤強化	米ドル特別第21期(借り換え)	2020/9/4		1,322	22					

◆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