

# Central Daily Market Report

2020年8月31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31日		2020年9月1日		2020年9月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	200		600		1,000	
財政	▲ 5,400		▲ 32,600		▲ 51,000	
資金過不足	▲ 5,200		▲ 32,000		▲ 50,000	
<b>金融調節</b>						
	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		8,800			
CP等買入		▲ 2,900		▲ 100		
貸出支援基金(成)					1,800	▲ 4,400
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 6,200		▲ 23,100		▲ 52,600	
当座預金残高	4,642,200		4,619,100		4,566,500	
準備預金残高	4,020,300					
積み終了先	4,020,200		9月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,020,000		積数		700	
非準備預金先	621,900		1日平均		0	
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	99.98%	日数	51.61%		

## ●2020年8月31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▲0.08～▲0.03%の出会いとなった。月末を跨ぐ取引であることから、調達を見送る先もあり、出会い水準は先週末よりやや低下した。一巡後は▲0.08～▲0.05%の調整の出会いが見られた。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

### ＜レポ市場＞

GC T/N(9/1-9/2)は、▲0.090～▲0.085%程度での出会い。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＞

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.135～▲0.129%で出合った。

### ＜CP市場＞

CP発行市場は、1件のみの発行と閑散で、償還は無かった。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

2020/8/31	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.084	0.045	▲ 0.010	23,139.76	257.11	105.52-54	105.82-83
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.027				-	▲ 0.083						
3W			▲ 0.030				-	▲ 0.084						
1M			▲ 0.029				-	▲ 0.088						
3M							▲ 0.127	▲ 0.095						
6M							▲ 0.121	▲ 0.137						
1Y							▲ 0.141	▲ 0.164						
									日付	8/24	8/25	8/26	8/27	8/28
									日銀当預残	4,505,700	4,481,600	4,476,900	4,635,700	4,648,400
									準備預金残	3,936,400	3,898,900	3,890,700	4,029,900	4,022,600
									マネタリーベース	5,691,100	5,666,700	5,662,400	5,822,000	5,835,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.048%	▲ 0.051%	▲ 0.054%	▲ 0.054%
									コール市場残高	113,036	114,441	111,542	112,035	110,763
									うち無担	93,708	95,693	92,953	92,894	91,731
									うちO/N	61,280	62,515	59,475	58,761	57,798
									うち有担	19,328	18,748	18,589	19,141	19,032

## ●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	棄分率	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
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/9/1			2,528	1,007	0.010		0.010	78.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/9/1			12,629	4,204	0.000		0.001	34.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/9/1			9,989	3,508	0.000		0.001	67.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/8/31	2020/9/1	▲ 0.350	154	154		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/31	2020/9/1	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年9月1日の予定

*7月の完全失業率(市場予想:3.0%)	*米国7月の建設支出	*10年利付国債入札(26,000億円、9/2発行)
*7月の有効求人倍率(市場予想:1.08倍)	*米国8月のISM製造業景況指数	
*4-6月期の法人企業統計調査季報	*ユーロ圏8月の消費者物価指数速報値	

◆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