

# Central Daily Market Report

2020年8月6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6日		2020年8月7日		2020年8月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 400			0
財政	▲ 900		5,400			▲ 32,000
資金過不足	▲ 1,600		5,000			▲ 32,000
<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						▲ 3,100
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,000					
CP等買入		▲ 100		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			3,000			
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
ETF買入	100		600			
国債補完供給		200				
※ドル資金供給用担保提供				2,500		
当預増減	4,600		10,400		▲ 35,100	
当座預金残高	4,475,500		4,485,900		4,450,800	
準備預金残高	3,895,800					
積み終了先	3,895,700		8月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,895,700		積数		500	
非準備預金先	579,700		1日平均		100	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,473,200	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	70.97%		

## ●2020年8月6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▲0.025~▲0.015%の出合いが中心となった。一巡後は調達サイドに一服感が見られ▲0.030~▲0.025%で散発的な出合いとなった。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(8/7-8/11)は、▲0.07~▲0.06%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2Y402~414、5Y136~144、10Y335~359、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~13等にビッグの出入りがあった。

### <短国市場>

本日はTB6M物(927回)の入札が実施された。WI取引において▲0.150~▲0.137%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1454%、按分落札利回▲0.1375%と、やや弱めな結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.137~▲0.135%出合いと、軟調に推移した。この他に、3M物が▲0.076%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額は600億円強であったが、発行総額は100億円弱にとどまり、案件の少ない閑散なマーケットとなった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/8/6	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.061	0.015	0.010	22,418.15	▲ 96.70	105.55-57	105.62-64
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.063						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.070						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.074						
3W							-	▲ 0.077						
1M							-	▲ 0.085						
3M			0.070				▲ 0.076	▲ 0.101						
6M							▲ 0.135	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.175	▲ 0.178						
									日付	7/30	7/31	8/3	8/4	8/5
									日銀当預残	4,559,000	4,574,500	4,532,600	4,478,500	4,470,900
									準備預金残	3,944,900	3,943,900	3,963,300	3,901,800	3,901,700
									マネタリーベース	5,747,900	5,763,100	5,720,600	5,666,000	5,658,000
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.021%	▲0.020%	▲0.021%	▲0.022%
									コール市場残高	110,911	120,246	107,130	111,842	104,403
									うち無担	92,669	102,992	88,993	92,615	85,175
									うちO/N	60,346	72,104	57,385	60,857	53,617
									うち有担	18,322	17,254	18,137	19,227	19,228

## ●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)
国庫短期証券	927	-	33,000	2020/8/11	2021/2/10	87,496.0	27,081.6	100.0690	▲0.1375%	42.2311%	100.0730	▲0.1454%	5,918.0
物価連動10年	25	0.20%	2,000	2020/8/7	2030/3/10	6,409.0	1,999.0	101.8500		0.0060%		72.5000%	

## ●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)		2020/8/6	2020/8/7	▲ 0.350	3	3		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/8/6	2020/8/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/11	2020/8/17	0.340	0	0				

## ●2020年8月7日の予定

- \*6月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲7.5%)
- \*6月の毎月勤労統計調査速報
- \*6月の特定サービス産業動態統計速報
- \*6月の景気動向指数速報
- \*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- \*米国6月の卸売売上高
- \*米国6月の消費者信用残高
- \*米国7月の雇用統計
- \*国庫短期証券(928回)入札(3ヶ月、75,500億円、8/11発行)
- \*エネルギー対策借入(7,000億円、8/20借入)

◆本資料は信頼できるとさ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