Central Daily Market Report

2020年8月7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7日 需給速報		2020年8月11日 需給予想		2020年8月12日 当社予想	
銀行券	▲ 400		500		0	
財政	6,200		▲ 30,000		5,000	
資金過不足	5,800		▲ 29,500		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			2,900	▲ 3,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,500			
CP等買入		▲ 700		▲ 300		
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					
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入	600					
国債補完供給						
※ドル資金供給用担保国債供給		2,500				
当預増減	11,200		▲ 20,500		5,000	

当座預金残高	4,486,700	4,466,200	4,471,200
準備預金残高	3,895,700		
積み終了先	3,895,700		
超過準備	3,895,700		
非準備預金先	591,000		

8月11日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	0

積み期間（7/16～8/15）の所要準備額			3,491,600
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数 83.87%

●2020年8月7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。連休を挟む取引となることから、一部取り上がる先がみられたものの、出合い水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は調達サイドに一服感が見られ▲0.030～▲0.020%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(8/11-8/12)は、▲0.06～▲0.05%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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB3M（928回）物の入札が実施された。WI取引において▲0.078～▲0.074%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0737%、按分落札利回▲0.0669%と、弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.070～▲0.063%出合いと軟調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額が400億円強となった。商社・ゴム等の業態からまとまったロットの発行も見られたが、案件は少なく、発行総額500億円弱となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/8/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.020				－	▲ 0.063
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.057
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.020				－	▲ 0.066
2W	▲ 0.033	▲ 0.005	▲ 0.024				－	▲ 0.071
3W	▲ 0.030	0.020	▲ 0.005				－	▲ 0.076
1M							－	▲ 0.083
3M							▲ 0.065	▲ 0.097
6M							▲ 0.135	▲ 0.146
1Y							▲ 0.175	▲ 0.175

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.005	▲ 0.010	22,329.94	▲ 88.21	105.57-59	105.59-61

日付	7/31	8/3	8/4	8/5	8/6
日銀当預残	4,574,500	4,532,600	4,478,500	4,470,900	4,475,500
準備預金残	3,943,900	3,963,300	3,901,800	3,901,700	3,895,800
マネタリーベース	5,763,100	5,720,600	5,666,000	5,658,000	5,663,300
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.020%	▲0.021%	▲0.022%	▲0.022%
コール市場残高	120,246	107,130	111,842	104,403	112,232
うち無担	102,992	88,993	92,615	85,175	92,956
うちO/N	72,104	57,385	60,857	53,617	61,298
うち有担	17,254	18,137	19,227	19,228	19,276

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	928	－	75,500	2020/8/11	2020/11/9	167,444.0	61,563.60	100.0165	▲0.0669%	48.8452%	100.0182	▲0.0737%	13,936.0
エネルギー対策	－	－	7,000	2020/8/20	2021/8/20	166,296.0	6,999.87		0.0000%	4.2094%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2020/8/11	2020/8/24		2,851	2,851				
国債買入（残存期間1年以下）	1,000	2020/8/11			3,504	1,000	0.009		0.013	24.2
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,200	2020/8/11			14,081	4,210	0.003		0.003	84.6
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,200	2020/8/11			8,754	4,203	▲0.005		▲0.004	90.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/8/7	2020/8/11	▲ 0.350	4	4		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/8/7	2020/8/11	▲ 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11日の予定

*6月の国際収支
*7月の景気ウォッチャー調査
*米国7月の生産者物価指数

◆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。
◆本資料は何ら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論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