

<<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 1,000	2,000
財政		100	2,700	▲ 49,000
資金過不足		▲ 1,300	1,700	▲ 47,000
貸出				
売出手形				
本店共通				
全店共通				
共通(固定)				1,000
66.048				▲ 1,300
国債買現				
CP買現				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入				
CP等買入		▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,241				
社債等買入			1,300	
			▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 400	900	▲ 300
当預増減		▲ 1,700	2,600	▲ 47,300

当座預金残高	2,273,700	7/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,056,700		2,021,900
積み終了先	585,900	7/17以降の残り所要積立額	
超過準備	449,800	積数	752,300
非準備先残高	217,000	1日平均	25,100
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			2,021,900
準備預金進捗率	62.79%	(実績)	3.23% (日数)

7/15のマネターベース		3,225,800	
7/15コール	合計	195,820	無担 61,459 有担 134,361
コール前日増減	計	▲ 3,236	無担 ▲ 4,135 有担 899

7/16の加重平均レート(速報)				7/15の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.020 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.055 ~0.125 (0.076)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.068 ~0.120 (0.077)				T/N		0.068 ~0.125 (0.077)		
0.069 ~0.130 (0.097)				S/N				
0.117 ~0.310 (0.120)				1W		0.064 ~0.130 (0.089)		
				2W		0.076 (0.076)		
				3W				
		0.08-0.13	-	1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.012-0.00	3M				
		-	▲0.042-▲0.03	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	7/21 ~ 10/19 (90日間)	応札	960億円	落札	960億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	2,398億円	7/16 ~ 7/17 (1日間)	応札	6億円	落札	6億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
CP買入	4,000億円	7/22	応札	10,801億円	落札	3,993億円	按分レート	0.084%	84.7%	平均落札レート	0.087%

T-Bill3M 応札18兆242億円 落札4兆7,307億7,000万円(非競争入札:3,792億円) 7/21~10/19 ▲0.0020% 按分23.0153% 平均▲0.0081%
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札7兆3,003億円 落札2兆2,787億円(I非競争入札:2,197億円) 7/21~2020/6/20 0.118% 按分43.2823% 平均0.116%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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。」

<< 7/17の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,276,300	前日比	2,600
O/N	0.065~0.075	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.065~0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 16日のインターバンク市場動向 >>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆1,000億円減少の172兆3,000億円(当座預金残高見込みは227兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.069~0.075%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.074%~0.075%の出合いが中心。一巡後は徐々に取り下がり、後場にかけては0.07%近辺での出合いに落ち着いた。一方で、まとまった金額の取引に関しては0.07%台後半の出合いも散見された。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。本日の共通担保資金供給オペは、8,000億円のオファーに対して、応札額960億円(期落ち分1,265億円)の札割れとなった。

<< 16日のオープン市場動向 >>

短国現先レートS/Nは前日からやや上昇した。短国3M物入札は按分落札レート▲0.002%(按分比率23.0153%)、平均落札レート▲0.0081%と堅調な結果となった。セカンダリーは▲0.002~0.000%の出合い。その他では6M物で▲0.042~▲0.03%の出合いがみられた。CP市場は発行日が五・十日にあたり、鉄鋼・ノンバンク業態からのまとまった案件等で、償還総額2,300億円程度に対して発行総額は3,000億円程度となった。発行レートは前日に続き、月内償還物でやや上昇した。CP等買入オペが4,000億円で通知され、按分レート0.084%、平均レート0.087%という結果となった。

<< 17日の材料 >>

- *米国6月の消費者物価指数
- *米国6月の住宅着工件数
- *米国7月のミシガン大消費者信頼感指数速報

<< コール6月積み期間分の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.07193%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07100%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.440	▲0.010	日経平均株価(終値)	20,600.12	136.79	為替(9時)	123.91-93
						為替(5時)	123.92-94

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	7/9	7/10	7/13	7/14	7/15	7/16
日銀当預残	2,290,200	2,285,200	2,270,100	2,272,600	2,275,400	2,273,700
準備預金残	2,069,500	2,074,200	2,056,600	2,065,000	2,062,700	2,056,700
レート	0.075%	0.076%	0.075%	0.076%	0.076%	0.075%
月中平均	0.07322%	0.07392%	0.07400%	0.07414%	0.07427%	0.07431%

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