

Central Daily Market Report

2020年7月1日(水)

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7月1日		2020年7月2日		2020年7月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,300		▲ 1,000	
財政	▲ 28,000		▲ 31,100		▲ 22,000	
資金過不足	▲ 28,600		▲ 32,400		▲ 23,000	
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	30,000					
国債買入			4,600			
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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						
ETF買入	100		900			
国債補充供給		2,400				
※ドル資金供給用担保提供供給	▲ 4,000					35,500
当預増減	▲ 200		▲ 27,100		12,500	
当座預金残高	4,470,000		4,442,900		4,455,400	
準備預金残高	3,850,500					
積み終了先	3,850,400		7月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,850,300		積数		900	
非準備預金先	619,500		1日平均		100	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,320,800	
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	53.33%		

●2020年7月1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▲0.06~▲0.035%近辺での出合いとなった。四半期末要因が剥落したことで調達先が増加し、レート水準は前日比で上昇した。ターム物はショートターム物で▲0.05%近辺の出合いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/2-7/3)は、▲0.090~▲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2Y402~413、5Y136~143、10Y335~358、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~13等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.092~▲0.090%、1Y物が▲0.220%で出合った。

<CP市場>

発行市場は償還総額1,200億円程度に対して、発行総額は2,200億円程度と発行超であった。一部の建設・卸売業態において大型発行があったものの、多くは小型案件であったため落ち着いたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/7/1	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.071	0.045	0.020	22,121.73	▲ 166.41	107.98-00	107.56-58
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.037				-	▲ 0.081						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.083						
1M	▲ 0.060	▲ 0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.090						
3M								▲ 0.090						
6M								▲ 0.230						
1Y								▲ 0.220						

●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	案分率	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	2020/7/2			3,496	1,002	0.005		0.009	12.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/7/2			9,001	3,507	0.006		0.007	56.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/1	2020/7/2	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/1	2020/7/2	▲ 0.350	0	0				

●2020年7月2日の予定

*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支	*米国5月の貿易収支	*10年利付国債入札(26,000億円、7/3発行)
*6月のマネタリーベース	*米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫	
	*米国6月の雇用統計	

◆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自身でなされようお願ひ申し上げます。

◆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