

Central Daily Market Report

2020年7月2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7月2日 需給速報	2020年7月3日 需給予想	2020年7月6日 当社予想
銀行券	▲ 1,300	▲ 800	1,000
財政	▲ 31,000	▲ 24,200	▲ 31,000
資金過不足	▲ 32,300	▲ 25,000	▲ 30,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	4,600		
CP等買入		▲ 200	▲ 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			▲ 100
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入	900	400	
国債補充供給	▲ 100		100
※ドル資金供給用担保資産供給			36,300
当預増減	▲ 27,100	11,400	▲ 30,000
当座預金残高	4,442,900	4,454,300	4,424,300
準備預金残高	3,831,500		
積み終了先	3,831,400		7月3日以降の残り所要積立額
超過準備	3,831,400		積数
非準備預金先	611,400		1日平均
			900
			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
			56.67%

●2020年7月2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▲0.055~▲0.035%近辺での出会いとなった。地合いに大きな変化は見られず、前日比で概ね横ばいとなった。ターム物は引き続きショートターム物で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(7/3-7/6)は、▲0.090~▲0.080%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2Y402~413、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▲0.085~▲0.080%で出合った。

<CP市場>

発行市場は発行・償還総額共に500億円程度であった。一部の卸売業態において大型発行があったものの、案件数は少なく閑散な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

2020/7/2	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.090	0.040	▲ 0.005	22,145.96	24.23	107.36-38	107.47-49
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	▲ 0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.065	▲ 0.050	▲ 0.054				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.085						
1M							-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.080	▲ 0.107						
6M							▲ 0.210	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.210	▲ 0.189						
									日付	6/25	6/26	6/29	6/30	7/1
									日銀当預残	4,437,000	4,473,600	4,448,500	4,470,200	4,470,000
									準備預金残	3,820,200	3,869,700	3,849,800	3,868,000	3,850,500
									マネタリーベース	5,615,400	5,653,600	5,629,800	5,652,400	5,652,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.038%	▲ 0.041%	▲ 0.068%	▲ 0.041%
									コール市場残高	128,321	131,863	126,174	103,753	111,799
									うち無担	108,096	111,168	105,131	85,803	94,145
									うちO/N	61,827	66,389	61,812	64,720	64,117
									うち有担	20,225	20,695	21,043	17,950	17,654

●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)
10年利付国債	359	0.10%	26,000	2020/7/3	2030/6/20	77,318.0	21,122.0	100.3900	0.0600%	48.3429%	100.4100	0.0580%	4,867.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/2	2020/7/3	▲ 0.350	91	91		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/2	2020/7/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/7	2020/7/14	0.320	94	94				

●2020年7月3日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み	*New York祝日(Independence Day, observed)	*国庫短期証券(919回)入札(3ヶ月、81,400億円、7/6発行)
-------------------	---	-------------------------------------

◆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