

# Central Daily Market Report

2020年7月3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7月3日 需給速報	2020年7月6日 需給予想	2020年7月7日 当社予想
銀行券	▲ 800	▲ 100	1,000
財政	▲ 24,500	▲ 34,400	0
資金過不足	▲ 25,300	▲ 34,500	1,000
<b>金融調節</b>	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		9,200	
CP等買入		▲ 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	400	1,000	
国債補完供給		100	
※ドル資金供給用担保提供		36,300	
当預増減	11,100	▲ 24,300	1,000
当座預金残高	4,454,000	4,429,700	4,430,700
準備預金残高	3,847,500		
積み終了先	3,847,400		7月6日以降の残り所要積立額
超過準備	3,847,400		積数
非準備預金先	606,500		1日平均
			600
			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	99.98%	日数
			66.67%

## ●2020年7月3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~▲0.03%近辺での出会いとなった。週末要因で大手行が取り上がったこともあり、レート水準は前日比で上昇した。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(7/6-7/7)は、▲0.075~▲0.055%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>

本日は、TB3M物(919回)の入札が実施された。WI取引において▲0.095~▲0.083%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.0962%、按分落札利回▲0.0882%となった。9月末を越えることもあり、按分利回こそ若干上昇したものの、平均利回は低下した。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.108~▲0.105%出会いと堅調に推移した。

### <CP市場>

発行市場は償還総額800億円程度に対して、発行総額は1,800億円程度と発行超であった。複数業態において大型発行が見られ、月の序盤としては活況なマーケットであった。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

2020/7/3	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	▲ 0.034				-	▲ 0.083	0.020	▲ 0.020	22,306.48	160.52	107.49-50	107.48-49
T/N							-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.075						
2W	▲ 0.075	▲ 0.005	▲ 0.049				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.084						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.092						
3M			0.070				▲ 0.109	▲ 0.104						
6M							▲ 0.210	▲ 0.161						
1Y							▲ 0.218	▲ 0.189						
									日付	6/26	6/29	6/30	7/1	7/2
									日銀当預残	4,473,600	4,448,500	4,470,200	4,470,000	4,442,900
									準備預金残	3,869,700	3,849,800	3,868,000	3,850,500	3,831,500
									マネタリーベース	5,653,600	5,629,800	5,652,400	5,652,700	5,627,000
									無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.041%	▲0.068%	▲0.041%	▲0.039%
									コール市場残高	131,863	126,174	103,753	111,799	125,606
									うち無担	111,168	105,131	85,803	94,145	107,297
									うちO/N	66,389	61,812	64,720	64,117	73,194
									うち有担	20,695	21,043	17,950	17,654	18,309

## ●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	919	-	81,400	2020/7/6	2020/10/5	232,908.1	66,182.4	100.0220	▲0.0882%	30.5318%	100.0240	▲0.0962%	15,217.0

## ●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/7/6			12,631	4,206	0.000		0.000	77.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/7/6			7,722	3,504	▲0.005		▲0.004	37.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/7/6			3,935	1,208	▲0.007		▲0.006	54.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/3	2020/7/6	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/3	2020/7/6	▲0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3,000	2020/7/9			6,162	3,000	▲0.092		▲0.073	9.0

## ●2020年7月6日の予定

\*米国6月のISM非製造業景況指数

◆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