

Central Daily Market Report

2020年7月6日(月)

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6日		2020年7月7日		2020年7月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		500		0	
財政	▲ 34,500		7,200		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 34,600		7,700		▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,200		4,200			
CP等買入				▲ 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						
E T F買入	1,000					
国債補完供給						
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 24,400		11,700		▲ 5,000	
当座預金残高	4,429,600		4,441,300		4,436,300	
準備預金残高	3,835,700					
積み終了先	3,835,700		7月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,835,700		積数		500	
非準備預金先	593,900		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	99.98%	日数	70.00%		

●2020年7月6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%近辺での出合いとなった。引き続き大手行の資金調達ニーズが強く、レート水準は概ね横ばいで推移した。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(7/7-7/8)は、▲0.075~▲0.060%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▲0.114~▲0.112%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は鉄鋼・商社業態において大型発行が実施された。償還総額650億円程度に対して、発行総額は2,100億円程度と発行超であった。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

2020/7/6	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.034				-	▲ 0.066	0.040	0.020		22,714.44	407.96	107.59-60	107.59-60
T/N							-	▲ 0.068							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.048				-	▲ 0.072							
2W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.026				-	▲ 0.079							
3W							-	▲ 0.082							
1M							-	▲ 0.091							
3M							▲ 0.114	▲ 0.106							
6M							▲ 0.185	▲ 0.160							
1Y							▲ 0.210	▲ 0.189							
									日付	6/29	6/30	7/1	7/2	7/3	
									日銀当預残	4,448,500	4,470,200	4,470,000	4,442,900	4,454,000	
									準備預金残	3,849,800	3,868,000	3,850,500	3,831,500	3,847,500	
									マネタリーベース	5,629,800	5,652,400	5,652,700	5,627,000	5,638,900	
									無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.068%	▲0.041%	▲0.039%	▲0.034%	
									コール市場残高	126,174	103,753	111,799	125,606	119,507	
									うち無担	105,131	85,803	94,145	107,297	101,459	
									うちO/N	61,812	64,720	64,117	73,194	66,206	
									うち有担	21,043	17,950	17,654	18,309	18,048	

●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	棄分率	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	応募総額(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5年超10年以下)	4,200	2020/7/7			8,275	4,203	0.011		0.012	73.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/6	2020/7/7	▲ 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)		2020/7/6	2020/7/7	▲ 0.350	0	0				

●2020年7月7日の予定

*5月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲12.2%)	*30年利付国債入札(9,000億円、7/8発行)
*5月の毎月勤労統計調査速報	*交付税特別会計借入(10,950億円、7/17借入)
*5月の景気動向指数速報	
*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引	

◆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