Central Daily Market Report

2020年7月7日（火）
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7日 需給速報		2020年7月8日 需給予想		2020年7月9日 当社予想	
銀行券	500		200		0	
財政	7,500		▲ 5,400		2,000	
資金過不足	8,000		▲ 5,200		2,000	
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			25,000			
国債買入	4,200					
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入					3,000	
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入			1,700			
国債補完供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 3,700			
当預増減	11,800		17,900		5,000	

当座預金残高	4,441,400	4,459,300	4,464,300
準備預金残高	3,832,600		
積み終了先	3,832,500		
超過準備	3,832,500		
非準備預金先	608,800		

7月8日以降の残り所要積立額	
積数	600
1日平均	100

積み期間（6/16～7/15）の所要準備額			3,357,200
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	73.33%

●2020年7月7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▲0.04～▲0.025%近辺での出合いとなった。積み最終の着地に向けて資金調達ニーズが増加しており、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>

GCT/N(7/8-7/9)は、▲0.090～▲0.080%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2Y402～414、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、短国買入オペが前回から5,000億円減額の25,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.014%、按分落札利回り較差+0.010%と、弱めな結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.111～▲0.109%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は商社業態において大型発行が実施された。償還総額1,400億円程度に対して、発行総額は2,000億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

2020/7/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.027				－	▲ 0.074
T/N							－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.043				－	▲ 0.083
2W			▲ 0.010				－	▲ 0.084
3W							－	▲ 0.086
1M			0.000				－	▲ 0.094
3M							▲ 0.114	▲ 0.108
6M							▲ 0.165	▲ 0.161
1Y							▲ 0.195	▲ 0.186

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.033	▲ 0.007	22,614.69	▲ 99.75	107.35-37	107.63-64

日付	6/30	7/1	7/2	7/3	7/6
日銀当預残	4,470,200	4,470,000	4,442,900	4,454,000	4,429,600
準備預金残	3,868,000	3,850,500	3,831,500	3,847,500	3,835,700
マネタリーベース	5,652,400	5,652,700	5,627,000	5,638,900	5,614,600
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.041%	▲0.039%	▲0.034%	▲0.034%
コール市場残高	103,753	111,799	125,606	119,507	119,158
うち無担	85,803	94,145	107,297	101,459	100,996
うちO/N	64,720	64,117	73,194	66,206	63,303
うち有担	17,950	17,654	18,309	18,048	18,162

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
30年利付国債	67	0.60%	9,000	2020/7/8	2050/6/20	28,719.0	7,326.0	99.6000	0.6150%	29.2307%	99.6800	0.6120%	1,665.0
交付税特会	－	－	10,950	2020/7/17	2021/1/15	350,375.0	10,950.14		0.0000%	3.1253%		0.0000%	

●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
国庫短期証券買入	25,000	2020/7/8			70,759	25,002	0.010		0.014	75.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/7/7	2020/7/8	▲ 0.350	162	162		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/7/7	2020/7/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/9	2020/7/16	0.330	19,607	19,607				
米ドル資金供給		2020/7/9	2020/10/1	0.320	7,910	7,910				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2020/7/8	2020/7/17		2,080	2,080		▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2020/7/8	2020/10/2		1,559	1,559		▲0.100	▲0.100	

●2020年7月8日の予定

*5月の国際収支
*6月の景気ウォッチャー調査
*米国5月の消費者信用残高

◆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。
◆本資料は何ら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