

# Central Daily Market Report

2020年7月8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8日 需給速報	2020年7月9日 需給予想	2020年7月10日 当社予想
銀行券	200	▲ 200	0
財政	▲ 6,800	3,900	▲ 32,000
資金過不足	▲ 6,600	3,700	▲ 32,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
	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	25,000		
国債買入		8,800	
CP等買入		▲ 100	▲ 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		3,000	
新型コロナ対応金融支援特別			21,100
E T F買入	1,700		
国債補完供給	▲ 200	200	200
※ドル資金供給用担保提供供給	▲ 3,700		
当預増減	16,300	15,400	▲ 10,900
当座預金残高	4,457,700	4,473,100	4,462,200
準備預金残高	3,828,500		
積み終了先	3,828,400		7月9日以降の残り所要積立額
超過準備	3,828,400		積数
非準備預金先	629,200		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	99.99%	日数
			76.67%

## ●2020年7月8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▲0.035~▲0.02%近辺での出会いとなった。引き続き資金調達ニーズが強いなか、ビッドサイドの増加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(7/9~7/10)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2Y402~414、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、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は食品業態においてまとまった発行が実施された。償還総額900億円程度に対して、発行総額は1,100億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

2020/7/8	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.084	0.015	▲ 0.018	22,438.65	▲ 176.04	107.57-58	107.47-49
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.041				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.035				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M							-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.114	▲ 0.104						
6M							▲ 0.165	▲ 0.159						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.185						
									日付	7/1	7/2	7/3	7/6	7/7
									日銀当預残	4,470,000	4,442,900	4,454,000	4,429,600	4,441,400
									準備預金残	3,850,500	3,831,500	3,847,500	3,835,700	3,832,600
									マネタリーベース	5,652,700	5,627,000	5,638,900	5,614,600	5,625,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.039%	▲ 0.034%	▲ 0.034%	▲ 0.027%
									コール市場残高	111,799	125,606	119,507	119,158	116,632
									うち無担	94,145	107,297	101,459	100,996	99,575
									うちO/N	64,117	73,194	66,206	63,303	61,587
									うち有担	17,654	18,309	18,048	18,162	17,057

## ●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	応募総額(億円・百万ドル)	着札総額(億円・百万ドル)	抜分レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均着札レート・利回差・価格差	抜分比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2020/7/9			3,100	1,002	0.007		0.008	43.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/7/9			13,381	4,206	0.003		0.004	43.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/7/9			9,898	3,508	▲ 0.003		▲ 0.003	78.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/8	2020/7/9	▲ 0.350	236	236		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/8	2020/7/9	▲ 0.350	0	0				

## ●2020年7月9日の予定

*5月の機械受注統計 (市場予想:電力除く民需、前月比▲5.4%)	*米国5月の卸売売上高	*国庫短期証券(920回)入札 (6ヶ月、30,000億円、7/10発行)
*5月の特定サービス産業動態統計速報		*5年利付国債入札 (25,000億円、7/10発行)
*6月のマネーストック		

◆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