

# Central Daily Market Report

2020年7月9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9日		2020年7月10日		2020年7月13日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 400		100		1,000	
財政	4,800		▲ 32,400		▲ 20,000	
資金過不足	4,400		▲ 32,300		▲ 19,000	
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						▲ 1,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	8,800					
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
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						▲ 5,600
E T F買入			400			
国債補完供給		200				
米ドル資金供給用担保提供供給				21,500		
当預増減	16,100		▲ 10,800		▲ 26,500	
当座預金残高	4,473,800		4,463,000		4,436,500	
準備預金残高	3,845,900					
積み終了先	3,845,800				7月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,845,800				積数 400	
非準備預金先	627,900				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 80.00%	

## ●2020年7月9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~▲0.015%近辺での出会いとなった。引き続き積み最終の着地に向けて資金調達ニーズが強く、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(7/10-7/13)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>

本日は、TB6M物(920回)の入札が実施された。WI取引において▲0.170~▲0.155%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1764%、按分落札利回▲0.1725%としっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.190~▲0.178%出会いと堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は食品業態において大型発行が実施された。償還総額300億円程度に対して、発行総額は1,000億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

2020/7/9	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)	為替(17時)	
O/N	▲0.060	0.001	▲0.021				-	▲0.083	0.015	0.000	22,529.29	90.64	107.28-29	107.24-25		
T/N	▲0.040	▲0.020	▲0.030				-	▲0.080								
S/N							-	-								
1W	▲0.050	▲0.001	▲0.012				-	▲0.083								
2W							-	▲0.083								
3W			0.000				-	▲0.089								
1M							-	▲0.094								
3M							▲0.115	▲0.104								
6M							▲0.180	▲0.158								
1Y							▲0.155	▲0.179								
											日付	7/2	7/3	7/6	7/7	7/8
											日銀当預残	4,442,900	4,454,000	4,429,600	4,441,400	4,457,700
											準備預金残	3,831,500	3,847,500	3,835,700	3,832,600	3,828,500
											マネタリーベース	5,627,000	5,638,900	5,614,600	5,625,900	5,641,900
											無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.034%	▲0.034%	▲0.027%	▲0.023%
											コール市場残高	125,606	119,507	119,158	116,632	116,828
											うち無担	107,297	101,459	100,996	99,575	99,657
											うちO/N	73,194	66,206	63,303	61,587	62,119
											うち有担	18,309	18,048	18,162	17,057	17,171

## ●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)
国庫短期証券	920	-	30,000	2020/7/10	2021/1/12	131,599.0	24,335.60	100.0880	▲0.1725%	67.8499%	100.0900	▲0.1764%	5,664.0
5年利付国債	144	0.10%	25,000	2020/7/10	2025/6/20	85,890.0	20,190.00	101.0000	▲0.1010%	82.5283%	101.0100	▲0.1030%	4,803.0

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/9	2020/7/10	▲0.350	34	34		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/9	2020/7/10	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/13	2020/7/20	0.340	0	0				

## ●2020年7月10日の予定

*6月の企業物価指数	*米国6月の生産者物価指数	*国庫短期証券(921回)入札(3ヶ月、76,400億円、7/13発行)
		*エネルギー対策借入(7,500億円、7/20借入)

◆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