

Central Daily Market Report

2020年7月10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10日 需給速報	2020年7月13日 需給予想	2020年7月14日 当社予想
銀行券	100	500	0
財政	▲ 31,900	▲ 19,000	▲ 23,000
資金過不足	▲ 31,800	▲ 18,500	▲ 23,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			1,900 ▲ 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		▲ 400	▲ 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			
新型コロナ対応金融支援特別			23,300 ▲ 5,600
E T F 買入	400		
国債補完供給			
※ドル資金供給用担保提供		21,500	
当増減	▲ 10,300	7,700	▲ 23,000
当座預金残高	4,463,500	4,471,200	4,448,200
準備預金残高	3,859,000		
積み終了先	3,859,000		7月13日以降の残り所要積立額
超過準備	3,858,900		積数 100
非準備預金先	604,500		1日平均 0
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 100.00%	日数 90.00%	

●2020年7月10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▲0.03~▲0.01%近辺での出合いとなった。引き続き資金調達ニーズが強い中、今積み期最後の週末となった事で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(7/13-7/14)は、▲0.075~▲0.055%程度での出合い。SCはローラー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、TB3M物(921回)の入札が実施された。WI取引において▲0.100~▲0.095%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0922%、按分落札利回▲0.0862%と、やや弱めの結果となった。償還日が海外の休日にあたることや、需給が悪化していること等が影響したと考えられる。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.0862~▲0.082%出合いと軟調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は償還総額1,250億円程度に対して、少額の発行が中心であったことから発行総額は140億円程度と閑散なマーケットとなった。発行レートは引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/7/10	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.082	0.015	0.000	22,290.81	▲ 238.48	107.23-25	106.84-85
T/N							-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.078						
2W							-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.087						
1M			0.000				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.088	▲ 0.104						
6M							▲ 0.181	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.178						
									日付	7/3	7/6	7/7	7/8	7/9
									日銀当預残	4,454,000	4,429,600	4,441,400	4,457,700	4,473,800
									準備預金残	3,847,500	3,835,700	3,832,600	3,828,500	3,845,900
									マネタリーベース	5,638,900	5,614,600	5,625,900	5,641,900	5,658,400
									無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.034%	▲0.027%	▲0.023%	▲0.021%
									コール市場残高	119,507	119,158	116,632	116,828	125,465
									うち無担	101,459	100,996	99,575	99,657	108,965
									うちO/N	66,206	63,303	61,587	62,119	71,942
									うち有担	18,048	18,162	17,057	17,171	16,500

●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	921	-	76,400	2020/7/13	2020/10/12	195,302.9	62,021.00	100.0215	▲0.0862%	68.2994%	100.0230	▲0.0922%	14,378.0
エネルギー対策	-	-	7,500	2020/7/20	2021/7/20	188,291.0	7,499.99		0.0000%	3.9832%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2020/7/13	2020/7/27		1,890	1,890				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/7/13			13,331	4,210	▲0.002		▲0.001	14.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/7/13			8,721	4,204	▲0.001		0.000	75.9
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/7/13			1,043	305	0.007		0.008	16.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/10	2020/7/13	▲ 0.350	21	21		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/10	2020/7/13	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/14	2020/7/21	0.330	108	108				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2020/7/13	2021/1/27	0	23,333

●2020年7月13日の予定

*5月の第3次産業活動指数

*米国6月の財政収支

◆本資料は信頼できるとさ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