Central Daily Market Report

2020年7月13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13日 需給速報		2020年7月14日 需給予想		2020年7月15日 当社予想	
銀行券	500		600		0	
財政	▲ 17,000		▲ 21,800		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 16,500		▲ 21,200		▲ 12,000	
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	▲ 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		▲ 500		
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				
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	9,500		▲ 21,500		▲ 12,000	

当座預金残高	4,473,000	4,451,500	4,439,500
準備預金残高	3,895,200		
積み終了先	3,895,200		
超過準備	3,895,200		
非準備預金先	577,800		

7月14日以降の残り所要積立額	
積数	100
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 93.33%

●2020年7月13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～▲0.015%近辺での出合いとなった。週末要因は剥落したものの、引き続き積み最終の着地に向けた資金調達ニーズが強く、レート水準は先週末から概ね横ばいでの推移となった。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(7/14-7/15)は、▲0.075～▲0.055%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、5Y136～144、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▲0.083～▲0.082%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、電気機器・卸売業態で大型発行があり、償還総額は1,800億円程度に対し、発行総額は3,800億円程度となった。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

2020/7/13	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.019				－	▲ 0.069
T/N							－	▲ 0.062
S/N							－	－
1W			0.000				－	▲ 0.074
2W			▲ 0.005				－	▲ 0.078
3W							－	▲ 0.084
1M							－	▲ 0.091
3M							▲ 0.084	▲ 0.104
6M							▲ 0.179	▲ 0.156
1Y							▲ 0.155	▲ 0.176

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）
0.025	0.010	22,784.74	493.93	106.91-93	106.98-00

日付	7/6	7/7	7/8	7/9	7/10
日銀当預残	4,429,600	4,441,400	4,457,700	4,473,800	4,463,500
準備預金残	3,835,700	3,832,600	3,828,500	3,845,900	3,859,000
マネタリーベース	5,614,600	5,625,900	5,641,900	5,658,400	5,648,000
無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.027%	▲0.023%	▲0.021%	▲0.017%
コール市場残高	119,158	116,632	116,828	125,465	127,734
うち無担	100,996	99,575	99,657	108,965	110,509
うちO/N	63,303	61,587	62,119	71,942	73,546
うち有担	18,162	17,057	17,171	16,500	17,225

●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Ｉ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）		2020/7/13	2020/7/14	▲ 0.350	143	143		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/7/13	2020/7/14	▲ 0.350	0	0				

●2020年7月14日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合（1日目、15日まで）
*米国6月の消費者物価指数
*流動性供給入札（5,000億円、7/15発行）
*交付税会計借入（10,000億円、7/27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