

Central Daily Market Report

2020年7月14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14日 需給速報	2020年7月15日 需給予想	2020年7月16日 当社予想
銀行券	600	100	0
財政	▲ 22,700	▲ 16,300	3,000
資金過不足	▲ 22,100	▲ 16,200	3,000
金融調節			
	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		30,000	
国債買入			
CP等買入		▲ 500	▲ 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			▲ 100
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補完供給		200	
米ドル資金供給用担保国債供給			▲ 4,400
当増減	▲ 22,400	8,900	3,000
当座預金残高	4,450,600	4,459,500	4,462,500
準備預金残高	3,868,900		
積み終了先	3,868,800		7月15日以降の残り所要積立額
超過準備	3,868,800		積数
非準備預金先	581,700		1日平均
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
			96.67%

●2020年7月14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~▲0.01%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た資金調達ニーズが強く、レート水準は前日比でやや上昇した。ターム物は新積み期スタートのショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/15-7/16)は、▲0.09~▲0.07%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、5Y136~144、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、短国買入オペアが前回より5,000億円増額の30,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.010%、按分落札利回較差+0.001%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.087~▲0.085%、6M物が▲0.184~▲0.177%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は閑散で、償還は少額、発行総額は400億円程度となった。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

2020/7/14 単位：%	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.073	0.020	▲ 0.005	22,587.01	▲ 197.73	107.28-29	107.26-28
T/N							-	▲ 0.075						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.045				-	▲ 0.077						
2W							-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.086						
1M	▲ 0.050	▲ 0.015	▲ 0.021				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.087	▲ 0.104						
6M							▲ 0.179	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.155	▲ 0.176						
									日付	7/7	7/8	7/9	7/10	7/13
									日銀当預残	4,441,400	4,457,700	4,473,800	4,463,500	4,473,000
									準備預金残	3,832,600	3,828,500	3,845,900	3,859,000	3,895,200
									マネタリーベース	5,625,900	5,641,900	5,658,400	5,648,000	5,657,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.027%	▲ 0.023%	▲ 0.021%	▲ 0.017%	▲ 0.019%
									コール市場残高	116,632	116,828	125,465	127,734	119,234
									うち無担	99,575	99,657	108,965	110,509	101,629
									うちO/N	61,587	62,119	71,942	73,546	65,241
									うち有担	17,057	17,171	16,500	17,225	17,605

●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非償額競争入札(億円)
流動性供給	313	-	5,000	2020/7/15		19,401.0	4,974.0		▲0.0070%	42.6808%		▲0.0080%	
交付税特会	-	-	10,000	2020/7/27	2021/1/22	302,959.0	10,000.26		0.0000%	3.3009%		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	30,000	2020/7/15			56,277	30,002	0.001		0.010	71.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/14	2020/7/15	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/14	2020/7/15	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/7/16	2020/7/30	0.340	11,860	11,860				
米ドル資金供給		2020/7/16	2020/10/8	0.320	6,970	6,970				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/7/15	2020/7/31		2,135	2,135		▲ 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	2020/7/15	2020/10/9		2,163	2,163		▲ 0.100	▲ 0.100	
被災地金融支援オペ		第1回	2020/7/17							61

●2020年7月15日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米国ページブック
*黒田日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望	*米国6月の鉱工業生産・設備稼働率
*5月の石油等消費動態統計	*英国6月の消費者物価指数

◆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