

Central Daily Market Report

2020年7月20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20日 需給速報	2020年7月21日 需給予想	2020年7月22日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 1,300	▲ 2,000
財政	▲ 40,000	1,300	▲ 3,000
資金過不足	▲ 41,200	0	▲ 5,000
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		25,000	
国債買入	12,400		
CP等買入		▲ 300	6,000 ▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 200
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入		200	
国債補完供給	▲ 200		200
<small>※ドル資金供給用担保貸付供給</small>			
当預増減	▲ 29,300	31,000	▲ 5,000
当座預金残高	4,460,600	4,491,600	4,486,600
準備預金残高	3,845,900		
積み終了先	3,843,600		7月21日以降の残り所要積立額
超過準備	3,842,800		積数 9,800
非準備預金先	614,700		1日平均 400
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			3,473,200
準備預金進捗率	実績 99.72%	日数 16.13%	

●2020年7月20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▲0.04~▲0.03%での調達が始まった。先週末と同様、調達ニーズは強く、一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出会いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.03%近辺での出会いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(7/21-7/22)は、▲0.07~▲0.06%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、10Y335~359、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~13等にビッグの出入りがあった。

<短国市場>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペが前回から5,000億円減額の25,000億円でオファーされた。平均落札利回り較差+0.004%、按分落札利回り較差+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▲0.090~▲0.088%、1Y物が▲0.183~▲0.180%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、陸運業態で1,500億円程度、食料品業態で1,000億円程度の案件が見られたことを筆頭に、石油・石炭や機械等、複数業態でもまとまった額の発行が散見され、発行総額は5,800億円程度と償還総額650億円程度を大きく上回った。発行レートは、大型案件においても上昇圧力は観測されず、0%近辺の低い水準で決着している。

●短期金融市場関連指標

2020/7/20	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	
単位：%	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.035				-	▲ 0.066	0.020	0.010	22,717.48	21.06	107.10-11	107.16-17
T/N							-	▲ 0.066						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.070						
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.026				-	▲ 0.076						
3W							-	▲ 0.083						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.090	▲ 0.103						
6M							▲ 0.180	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.184	▲ 0.178						
									日付	7/13	7/14	7/15	7/16	7/17
									日銀当預残	4,473,000	4,450,600	4,459,700	4,460,200	4,489,900
									準備預金残	3,895,200	3,868,900	3,848,700	3,874,600	3,897,200
									マネタリーベース	5,657,100	5,634,100	5,643,100	5,644,900	5,675,300
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.017%	▲0.014%	▲0.050%	▲0.037%
									コール市場残高	119,234	115,744	114,424	121,211	116,550
									うち無担	101,629	99,894	98,438	103,117	98,409
									うちO/N	65,241	63,256	64,610	71,559	65,691
									うち有担	17,605	15,850	15,986	18,094	18,141

●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	25,000	2020/7/21			50,077	25,006	0.001		0.004	2.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/20	2020/7/21	▲ 0.350	150	150		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/20	2020/7/21	▲ 0.350	0	0				

●2020年7月21日の予定

*6月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.1%	*国庫短期証券(924回)入札(6ヶ月、31,000億円、7/27発行) *20年利付国債入札(12,000億円、7/22発行) *交付税特別会計借入(10,000億円、7/31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お客様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