

Central Daily Market Report

2020年7月22日(水)
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22日 需給速報	2020年7月27日 需給予想	2020年7月28日 当社予想
銀行券	▲ 2,100	800	0
財政	6,100	▲ 43,000	2,000
資金過不足	4,000	▲ 42,200	2,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			3,100 ▲ 1,900
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			12,200
CP等買入		▲ 500	▲ 700
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	2,000
新型コロナ対応金融支援特別		45,500	▲ 200
E T F 買入		100	
国債補完供給		100	
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	3,500	15,900	4,000
当座預金残高	4,496,600	4,512,500	4,516,500
準備預金残高	3,882,100		
積み終了先	3,881,600		7月27日以降の残り所要積立額
超過準備	3,881,100		積数 2,800
非準備預金先	614,500		1日平均 100
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	99.92%	日数 35.48%

●2020年7月22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~▲0.02%での調達で始まった。週末5日積みの取引となるため、調達ニーズは強まり、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが見られた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。共通担保資金供給オペは20,000億円(7/27~8/11)オファーされ、応札額3,061億円(期落ち分1,890億円)と札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(7/27-7/28)は、▲0.065~▲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、5Y136~144、10Y335~359、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(925回)の入札が実施された。WI取引において、▲0.086~▲0.080%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0858%、按分落札利回▲0.0822%と無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.089~▲0.084%出合いと堅調に推移した。この他に、6M物が▲0.174%、1Y物が▲0.189%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、食料品、卸売業態で比較的多まった額の発行が見られ、発行総額は1,300億円程度と償還増額1,200億円程度を上回った。発行レートは引き続き横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2020/7/22	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.073	0.010	0.000	22,751.61	▲ 132.61	106.82-84	106.91-92
T/N							-	▲ 0.065						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.070						
2W							-	▲ 0.076						
3W							-	▲ 0.082						
1M							-	▲ 0.090						
3M							▲ 0.088	▲ 0.102						
6M							▲ 0.178	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.189	▲ 0.178						
									日付	7/15	7/16	7/17	7/20	7/21
									日銀当預残	4,459,700	4,460,200	4,489,900	4,460,600	4,493,100
									準備預金残	3,848,700	3,874,600	3,897,200	3,845,900	3,878,200
									マネタリーベース	5,643,100	5,644,900	5,675,300	5,647,300	5,681,300
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.050%	▲0.037%	▲0.035%	▲0.030%
									コール市場残高	114,424	121,211	116,550	121,547	125,335
									うち無担	98,438	103,117	98,409	103,824	107,450
									うちO/N	64,610	71,559	65,691	69,811	71,702
									うち有担	15,986	18,094	18,141	17,723	17,885

●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	925	-	76,400	2020/7/27	2020/10/26	190,305.0	61,946.1	100.0205	▲0.0822%	52.7652%	100.0214	▲0.0858%	14,453.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2020/7/27	2020/8/11		3,061	3,061				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/7/27			18,121	4,201	0.004		0.005	82.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/7/27			10,198	3,503	0.001		0.001	93.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/7/27			8,781	4,213	0.001		0.002	70.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/22	2020/7/27	▲ 0.350	19	19		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/22	2020/7/27	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/7/28			4,874	2,000	0.154		0.173	47.7
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		2020/7/27	2021/1/27	0	45,473					

●2020年7月23日の予定

*海の日

●2020年7月24日の予定

*スポーツの日
*東京オリンピック開催(延期)
*米国6月の新築一戸建て販売件数

●2020年7月27日の予定

*決定会合における主な意見(7月14-15日分)
*5月の景気動向指数改定状況(内閣府)
*米国6月の耐久財新規受注

◆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