

Central Daily Market Report

2020年7月29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29日		2020年7月30日		2020年7月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 100		100	
財政	6,700		4,000		8,000	
資金過不足	6,400		3,900		8,100	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	25,000					
国債買入			8,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 100	6,000	
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	700		900			
国債補完供給	▲ 100			100		
※ドル資金供給用担保提供供給	▲ 1,500					2,100
当増減	30,300		12,900		16,200	
当座預金残高	4,545,800		4,558,700		4,574,900	
準備預金残高	3,949,600					
積み終了先	3,949,200		7月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,949,200		積数		1,300	
非準備預金先	596,200		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	99.96%	日数	45.16%		

●2020年7月29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▲0.025~▲0.02%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一部で調達レートを引き上げる動きも見られたことから、昨日よりもレート水準が上昇した。一巡後は▲0.03%近辺での出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(7/30-7/31)は、▲0.10~▲0.065%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、10Y335~359、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~13等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、月末発行にあたり、電気機器業態の1社が1,600億円程度調達したことを筆頭に、輸送用機器や陸運業態でもまとまった額の発行が見られ、発行総額は5,900億円程度まで膨らんだものの、償還総額7,000億円程度を下回った。大型案件においても、足切りは流れず、概ね0%近辺で決着している。本日はCP等買入オペが、6,000億円でオファーされた。今月から買入日がT+2に変更になっており、月末発行日とオペ当日が重なることの影響が注視される中、結果は平均落札レート▲0.002%、按分落札レート▲0.005%と5/13のオペ以降初の前回比低下となった。応札額はT+2化もあってか8,820億円と大幅に減少しており、1/28以来の1兆円割れとなった。

●短期金融市場関連指標

2020/7/29	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.097	0.015	▲ 0.005	22,397.11	▲ 260.27	105.11-12	104.81-83
T/N							-	▲ 0.089						
S/N			▲ 0.080				-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.015	0.030	0.002				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.084						
1M	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.028				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.090	▲ 0.103						
6M							▲ 0.173	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.187	▲ 0.181						
									日付	7/20	7/21	7/22	7/27	7/28
									日銀当預残	4,460,600	4,493,100	4,496,600	4,509,000	4,515,500
									準備預金残	3,845,900	3,878,200	3,882,100	3,914,700	3,924,100
									マネタリーベース	5,647,300	5,681,300	5,686,800	5,698,300	5,704,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.035%	▲ 0.030%	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.026%
									コール市場残高	121,547	125,335	116,876	108,751	110,519
									うち無担	103,824	107,450	99,658	90,836	92,559
									うちO/N	69,811	71,702	65,210	58,573	60,196
									うち有担	17,723	17,885	17,218	17,915	17,960

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/7/30			12,621	4,208	0.002		0.002	82.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/7/30			11,866	3,511	▲0.003		▲0.003	55.7
国債買入(物価連動債)	300	2020/7/30			1,506	301	▲0.180		▲0.237	50.0
CP等買入	6,000	2020/7/31			8,820	5,985	▲0.005		▲0.002	59.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/29	2020/7/30	▲ 0.350	80	80		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/29	2020/7/30	▲ 0.350	0	0				

●2020年7月30日の予定

*6月の商業動態統計速報	*米国4-6月期のGDP速報値	*2年利付国債入札(30,000億円、8/3発行)
		*交付税特別会計借入(10,000億円、8/7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