

Central Daily Market Report

2020年7月30日(木)

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30日		2020年7月31日		2020年8月3日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		400		1,000	
財政	4,400		9,700		▲ 41,000	
資金過不足	4,200		10,100		▲ 40,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	8,100					
CP等買入		▲ 100	6,000	▲ 4,200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	900		800			
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保提供供給				2,200		
当増減	13,200		14,900		▲ 40,000	
当座預金残高	4,559,000		4,573,900		4,533,900	
準備預金残高	3,944,900					
積み終了先	3,944,800				7月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,944,700				積数	1,200
非準備預金先	614,100				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	99.97%	日数	48.39%		

●2020年7月30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~▲0.015%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、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▲0.02%近辺での出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(7/31-8/3)は、▲0.085~▲0.07%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、電気・ガス業や卸売業態で比較的多量に発行が見られ、発行総額は1,500億円程度と償還総額250億円程度を上回り、発行超のマーケットとなった。発行レートについては、昨日のCPオペにおけるレート低下の影響は特段みられず、引き続き横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/7/30	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.082	0.015	0.000	22,339.23	▲ 57.88	105.04-06	105.06-08
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.078						
2W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.084						
1M	▲ 0.030	0.000	▲ 0.020				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.088	▲ 0.101						
6M							▲ 0.172	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.187	▲ 0.181						
									日付	7/21	7/22	7/27	7/28	7/29
									日銀当預残	4,493,100	4,496,600	4,509,000	4,515,500	4,545,800
									準備預金残	3,878,200	3,882,100	3,914,700	3,924,100	3,949,600
									マネタリーベース	5,681,300	5,686,800	5,698,300	5,704,000	5,734,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.030%	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.026%	▲ 0.023%
									コール市場残高	125,335	116,876	108,751	110,519	108,342
									うち無担	107,450	99,658	90,836	92,559	91,784
									うちO/N	71,702	65,210	58,573	60,196	59,711
									うち有担	17,885	17,218	17,915	17,960	16,558

●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)
2年利付国債	415	0.10%	30,000	2020/8/3	2022/8/1	110,940.0	24,321.0	100.4600	▲0.1300%	20.4498%	100.4670	▲0.1330%	5,672.0
交付税特会	-	-	10,000	2020/8/7	2021/2/5	334,314.0	10,000.23		0.0000%	2.9913%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/30	2020/7/31	▲ 0.350	27	27		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/30	2020/7/31	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/3	2020/8/11	0.330	0	0				

●2020年7月31日の予定

- *6月の完全失業率(市場予想:3.1%)
- *6月の有効求人倍率(市場予想:1.16倍)
- *6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+1.2%)
- *7月の消費動向調査 *6月の住宅着工統計
- *米国6月の個人所得・消費支出
- *米国7月のシカゴPM景況感指数
- *ユーロ圏4-6月期のGDP1次速報
- *ユーロ圏7月の消費者物価指数速報値
- *国庫短期証券(926回)入札(3ヶ月、75,500億円、8/3発行)

◆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