

# Central Daily Market Report

2020年7月31日(金)  
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31日		2020年8月3日		2020年8月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	400		600		1,000	
財政	10,300		▲ 44,300		▲ 64,000	
資金過不足	10,700		▲ 43,700		▲ 63,000	
<b>金融調節</b>						
	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			4,700			
CP等買入	6,000	▲ 4,200		▲ 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	800		100			
国債補完供給						
米ドル資金供給用担保提供		2,200				
当預増減	15,500		▲ 39,100		▲ 63,000	
当座預金残高	4,574,500		4,535,400		4,472,400	
準備預金残高	3,943,900					
積み終了先	3,943,800		8月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,943,800		積数	800		
非準備預金先	630,600		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	99.98%	日数	58.06%		

## ●2020年7月31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。月末日の取引ではあるが、調達を控える先は少なく、引き続き強めの地合いとなった。一巡後は▲0.02%近辺での出合いが数件見られ、今月の取引を終えた。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(8/3-8/4)は、▲0.07~▲0.05%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等にビッグの出入りがあった。

### <短国市場>

本日はTB3M物(926回)の入札が実施された。WI取引において出合いは見られなかったものの、平均落札利回▲0.0862%、按分落札利回▲0.0802%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、▲0.084~▲0.079%出合いと、入札と同水準での推移となった。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還、発行ともに0件と非常に閑散であった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/7/31	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.073	0.010	▲ 0.005	21,710.00	▲ 629.23	104.69-70	104.44-46
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.066						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.018				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.081						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.080	▲ 0.101						
6M							▲ 0.172	▲ 0.157						
1Y							▲ 0.187	▲ 0.181						
									日付	7/22	7/27	7/28	7/29	7/30
									日銀当預残	4,496,600	4,509,000	4,515,500	4,545,800	4,559,000
									準備預金残	3,882,100	3,914,700	3,924,100	3,949,600	3,944,900
									マネタリーベース	5,686,800	5,698,300	5,704,000	5,734,500	5,747,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.028%	▲ 0.026%	▲ 0.023%	▲ 0.020%
									コール市場残高	116,876	108,751	110,519	108,342	110,911
									うち無担	99,658	90,836	92,559	91,784	92,669
									うちO/N	65,210	58,573	60,196	59,711	60,346
									うち有担	17,218	17,915	17,960	16,558	18,322

## ●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	926	-	75,500	2020/8/3	2020/11/2	174,797.0	61,457.3	100.0200	▲0.0802%	31.1848%	100.0215	▲0.0862%	14,042.0

## ●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)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/8/3			8,622	4,207	▲0.009		▲0.008	76.2
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/8/3			1,292	302	▲0.016		▲0.015	23.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/31	2020/8/3	▲ 0.350	30	30		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/31	2020/8/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/8/4	2020/8/12	0.330	0	0				

## ●2020年8月3日の予定

\*1-3月期のGDP2次速報改定値  
市場予想：前期比年率▲2.8%

\*米国6月の建設支出  
\*米国7月のISM製造業景況指数

◆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