

# Central Daily Market Report

2020年7月15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15日 需給速報	2020年7月16日 需給予想	2020年7月17日 当社予想
銀行券	100	▲ 1,100	▲ 1,000
財政	▲ 16,100	2,100	▲ 2,000
資金過不足	▲ 16,000	1,000	▲ 3,000
<b>金融調節</b>			
	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	30,000		
国債買入			
CP等買入		▲ 400	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			100
社債等買入		▲ 100	
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			100
国債補完供給			
※ドル資金供給用担保提供	▲ 4,400		23,200
当増減	9,100	1,100	19,200
当座預金残高	4,459,700	4,460,800	4,480,000
準備預金残高	3,848,700		
積み終了先	3,848,700		7月16日以降の残り所要積立額
超過準備	3,848,700		積数 3,473,200
非準備預金先	611,000		1日平均 112,000
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	0.00%	日数
			0.00%

## ●2020年7月15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▲0.02~▲0.01%近辺での出会いとなった。積み最終日となり、着地に向けた調達が増加したことからレート水準は前日比で上昇した。ターム物は新積み期スタートのショートタームで引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(7/16-7/17)は、▲0.085~▲0.07%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、10Y335~358、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、3M物が▲0.090%、6M物が▲0.175%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額700億円程度に対し、発行総額は550億円程度となった。発行レートは、引き続き低位で推移した。

## ●2020年7月16日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)	
*米国5月の企業在庫	*米国6月の小売売上高
*国庫短期証券(922回)入札(1年、35,000億円、7/20発行)	
*流動性供給入札(4,000億円、7/17発行)	

## ●短期金融市場関連指標

2020/7/15	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	
	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.074	0.020	0.000	22,945.50	358.49	107.24-25	107.01-02
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.079						
2W							-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.088						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.095						
3M			0.130				▲ 0.088	▲ 0.106						
6M							▲ 0.180	▲ 0.156						
1Y							▲ 0.152	▲ 0.175						
									日付	7/8	7/9	7/10	7/13	7/14
									日銀当預残	4,457,700	4,473,800	4,463,500	4,473,000	4,450,600
									準備預金残	3,828,500	3,845,900	3,859,000	3,895,200	3,868,900
									マネタリーベース	5,641,900	5,658,400	5,648,000	5,657,100	5,634,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.021%	▲ 0.017%	▲ 0.019%	▲ 0.017%
									コール市場残高	116,828	125,465	127,734	119,234	115,744
									うち無担	99,657	108,965	110,509	101,629	99,894
									うちO/N	62,119	71,942	73,546	65,241	63,256
									うち有担	17,171	16,500	17,225	17,605	15,850

## ●入札結果

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/15	2020/7/16	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/15	2020/7/16	▲ 0.350	0	0				

## ●金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。

(1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとする。

(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する。)

(2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて)

①ETFおよびJ-REITについて、当面は、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、積極的な買入れを行う。

(ETFおよびJ-REITの原則的な買入れ方針としては、引き続き、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう

買入れを行い、その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。)

②CP等、社債等については、それぞれ約2兆円、約3兆円の残高を維持する。これに加え、2021年3月末までの間、それぞれ7.5兆円の残高を上限に、

追加の買入れを行う。

◆本資料は信頼できるとさ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