

# Central Daily Market Report

2020年7月17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17日 需給速報	2020年7月20日 需給予想	2020年7月21日 当社予想
銀行券	▲ 800	▲ 1,100	▲ 1,000
財政	8,500	▲ 40,900	2,000
資金過不足	7,700	▲ 42,000	1,000
<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			
国債買入		12,400	
CP等買入		▲ 400	▲ 300
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援	100	▲ 1,100	
社債等買入		▲ 300	
新型コロナ対応金融支援特別			
E T F 買入			
国債補充供給			
米ドル資金供給用担保提供供給		23,700	
当増増減	29,700	▲ 29,900	1,000
当座預金残高	4,489,900	4,460,000	4,461,000
準備預金残高	3,897,200		
積み終了先	3,890,000		7月20日以降の残り所要積立額
超過準備	3,684,100		積数 12,900
非準備預金先	592,700		1日平均 500
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 99.63%	日数 12.90%	

## ●2020年7月17日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.04~▲0.03%での調達で始まった。積みの序盤ではあるものの調達ニーズは強く、週末要因も重なったことでレート水準は上昇した。一巡後は▲0.04%近辺での出合いが散見される程度で週末の取引を終えた。ターム物に関してはショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(7/20-7/21)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等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

本日はTB3M物(923回)の入札が実施された。WI取引において▲0.085~▲0.082%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0874%、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、▲0.090~▲0.0874%出合いと堅調な推移となった。この他、1Y物が▲0.182~▲0.178%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、小売業態で大型発行があり、償還総額は500億円程度に対し、発行総額は700億円程度となった。発行レートは、引き続き低位で推移した。本日は、CP等買入オペが6,000億円でオファーされた。結果は、平均落札レート▲0.001%、按分レート▲0.002%と、前回比で平均は低下し、按分は上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/7/17	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.082	0.010	0.000	22,696.42	▲ 73.94	107.28-29	107.11-12
T/N							-	▲ 0.063						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.036				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.036				-	▲ 0.076						
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.085						
1M	▲ 0.045	0.050	▲ 0.016				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.090	▲ 0.103						
6M							▲ 0.180	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.183	▲ 0.177						
									日付	7/10	7/13	7/14	7/15	7/16
									日銀当預残	4,463,500	4,473,000	4,450,600	4,459,700	4,460,200
									準備預金残	3,859,000	3,895,200	3,868,900	3,848,700	3,874,600
									マネタリーベース	5,648,000	5,657,100	5,634,100	5,643,100	5,644,900
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.014%	▲0.050%
									コール市場残高	127,734	119,234	115,744	114,424	121,211
									うち無担	110,509	101,629	99,894	98,438	103,117
									うちO/N	73,546	65,241	63,256	64,610	71,559
									うち有担	17,225	17,605	15,850	15,986	18,094

## ●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	923	-	76,400	2020/7/20	2020/10/19	212,706.0	61,949.3	100.0205	▲0.0822%	32.9550%	100.0218	▲0.0874%	14,450.0
交付税特会	-	-	10,000	2020/7/29	2021/1/26	320,954.0	10,000.20		0.0000%	3.1158%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,200	2020/7/20			15,089	4,207	0.002		0.002	33.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,500	2020/7/20			9,995	3,510	▲0.002		▲0.001	37.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,200	2020/7/20			11,041	4,203	▲0.002		▲0.002	96.5
国債買入(物価連動債)	300	2020/7/20			1,558	300		▲0.220	▲0.282	
CP等買入	6,000	2020/7/21			12,469	5,979	▲0.002		▲0.001	70.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/7/17	2020/7/20	▲0.350	5	5		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/7/17	2020/7/20	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/21	2020/8/4	0.340	92	92				

## ●2020年7月20日の予定

\*金融政策決定会合議事要旨(6月15、16日分)

\*6月の貿易統計

◆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