Central Daily Market Report

2020年7月21日（火）
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21日 需給速報		2020年7月22日 需給予想		2020年7月27日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 2,200		0	
財政	3,000		7,500		▲ 43,000	
資金過不足	1,600		5,300		▲ 43,000	
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						▲ 1,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	25,000					
国債買入						
CP等買入	6,000	▲ 200		▲ 500		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 200
ＥＴＦ買入	200					
国債補完供給	▲ 100	200		100		
＊ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	32,500		4,800		▲ 45,100	

当座預金残高	4,493,100	4,497,900	4,452,800
準備預金残高	3,878,200		
積み終了先	3,876,000		
超過準備	3,876,000		
非準備預金先	614,900		

7月22日以降の残り所要積立額	
積数	7,600
1日平均	300

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	99.78%	日数 19.35%

●2020年7月21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▲0.04～▲0.03%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▲0.03%近辺の出合いが見られた。また、一部業態が試し取りを実施したため、加重平均レートが上昇した。ターム物に関してはショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

GCT/N(7/22-7/27)は、▲0.08～▲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>

本日はTB6M物（924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▲0.1703%、按分落札利回▲0.1643%と順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.174 ～▲0.170%出合いと堅調な推移となった。この他に、3M物が▲0.085～▲0.083%、1Y物が▲0.187～▲0.185%で出合った。

<CP市場>

発行市場は小型の案件が多く、発行総額は700億円程度と、償還総額の1,200億円程度を下回った。発行レートについては、概ね横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2020/7/21	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.030	▲ 0.030				－	▲ 0.069
T/N							－	▲ 0.072
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.024				－	▲ 0.073
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.076
3W							－	▲ 0.083
1M			▲ 0.048				－	▲ 0.090
3M	0.070	0.300	0.123				▲ 0.085	▲ 0.103
6M							▲ 0.174	▲ 0.155
1Y							▲ 0.188	▲ 0.177

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.010	▲ 0.010	22,884.22	166.74	107.18-19	107.32-33

日付	7/14	7/15	7/16	7/17	7/20
日銀当預残	4,450,600	4,459,700	4,460,200	4,489,900	4,460,600
準備預金残	3,868,900	3,848,700	3,874,600	3,897,200	3,845,900
マネタリーベース	5,634,100	5,643,100	5,644,900	5,675,300	5,647,300
無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.014%	▲0.050%	▲0.037%	▲0.035%
コール市場残高	115,744	114,424	121,211	116,550	121,547
うち無担	99,894	98,438	103,117	98,409	103,824
うちO/N	63,256	64,610	71,559	65,691	69,811
うち有担	15,850	15,986	18,094	18,141	17,723

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	924	－	31,000	2020/7/27	2021/1/25	97,541.0	25,210.6	100.0820	▲0.1643%	23.7265%	100.0850	▲0.1703%	5,789.0
20年利付国債	173	0.40%	12,000	2020/7/22	2040/6/20	36,829.0	9,692.0	99.6500	0.4190%	28.5714%	99.7000	0.4160%	2,296.0
交付税特会	－	－	10,000	2020/7/31	2021/1/29	332,646.0	10,000.26		0.0000%	3.0063%		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）		2020/7/21	2020/7/22	▲ 0.350	128	128		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/7/21	2020/7/22	▲ 0.350	0	0				

●2020年7月22日の予定

*月例経済報告
*米国6月の中古住宅販売
*国庫短期証券（925回）入札
（3ヶ月、76,400億円、7/27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。
◆本資料は何ら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論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