

# Central Daily Market Report

2020年6月19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6月19日		2020年6月22日		2020年6月23日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200	▲ 800	▲ 1,000			
財政	▲ 17,800	75,700	2,000			
資金過不足	▲ 19,000	74,900	1,000			
<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						
CP等買入		▲ 700	▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	63,200	▲ 49,100				
被災地支援						
社債等買入		▲ 800				
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	▲ 100	400	100			
※ドル資金供給用担保提供供給		85,800				
当預増減	79,800		74,900		1,000	
当座預金残高	4,301,500		4,376,400		4,377,400	
準備預金残高	3,709,500					
積み終了先	3,706,100		6月22日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,701,900		積数	14,800		
非準備預金先	592,000		1日平均	600		
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,320,800	
準備預金進捗率	実績	99.55%	日数	20.00%		

## ●2020年6月19日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み序盤ながら週末要因により取り上がる先が見られ、前日対比でレートは上昇となった。立ち上がりは幅広い業態から▲0.05~▲0.03%での調達が見られた。一巡後はレートが低下し、▲0.08~▲0.045%の散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は資金運用ニーズは強いものの、調達サイドは様子見姿勢が強く、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/22-6/23)は、▲0.070~▲0.045%程度での出合い。SCはローラー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2Y402~413、5Y136~143、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>

本日はTB3M物(917回)の入札が実施された。WI取引において▲0.110%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1071%、按分落札利回▲0.1020%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、▲0.107~▲0.104%出合いと堅調な推移となった。この他に、1Y物が▲0.210%で出会った。

### <CP市場>

CP発行市場は、500億円程度の償還に対して、2,200億円弱の発行となった。電機業態が大型の発行を実施したことで、発行総額が膨らんだ。発行レートは概ね幅広い圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/6/19	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.088	0.010	0.000	22,478.79	123.33	107.00-01	106.96-97
T/N							-	▲ 0.062						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.035	▲ 0.048				-	▲ 0.073						
2W			0.500				-	▲ 0.084						
3W			0.100				-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.105	▲ 0.117						
6M							▲ 0.201	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.218	▲ 0.189						
									日付	6/12	6/15	6/16	6/17	6/18
									日銀当預残	4,199,700	4,231,500	4,202,200	4,183,400	4,221,700
									準備預金残	3,629,100	3,658,500	3,625,100	3,605,900	3,641,400
									マネタリーベース	5,366,100	5,398,100	5,369,100	5,351,300	5,391,900
									無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.018%	▲0.056%	▲0.055%	▲0.055%
									コール市場残高	138,658	128,996	137,385	133,558	140,088
									うち無担	119,805	109,963	118,004	113,724	120,727
									うちO/N	70,796	64,284	69,675	64,140	71,353
									うち有担	18,853	19,033	19,381	19,834	19,361

## ●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	917	-	81,400	2020/6/22	2020/9/23	199,576.0	66,093.5	100.0260	▲0.1020%	83.4342%	100.0273	▲0.1071%	15,306.0

## ●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・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)		2020/6/19	2020/6/22	▲ 0.350	55	55		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/19	2020/6/22	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/23	2020/6/30	0.340	0	0				

## ●2020年6月22日の予定

\*米国5月の中古住宅販売

◆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