

Central Daily Market Report

2020年6月22日(月)
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22日		2020年6月23日		2020年6月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 1,500		▲ 1,000	
財政	75,000		▲ 800		1,000	
資金過不足	74,200		▲ 2,300		0	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,800			
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入			300			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	74,100		8,400		0	
当座預金残高	4,375,600		4,384,000		4,384,000	
準備預金残高	3,753,200					
積み終了先	3,751,700		6月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,750,400		積数	12,000		
非準備預金先	622,400		1日平均	500		
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	99.64%	日数	23.33%		

●2020年6月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀勢を中心に▲0.06~▲0.04%の出会いとなった。一部業態より積極的な調達が見られたものの、週末要因が剥落した事で前営業日よりレートは若干低下した。一巡後は、閑散な状況のなか▲0.05%近辺で出会いが見られた程度であった。ターム物は引き続き運用ニーズは強いものの、調達意欲は限定的で、▲0.06%台の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/23-6/24)は、▲0.060~▲0.045%程度での出会い。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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y物が▲0.219%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還660億円に対して、石油・鉄鋼・ノンバンク業態からまとまった金額の発行が実施され、発行総額は2,000億円強となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/22	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.045				-	▲ 0.069	0.005	▲ 0.005	22,437.27	▲ 41.52	106.83-85	106.96-97
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.020	▲ 0.065				-	▲ 0.069						
2W							-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.103	▲ 0.115						
6M							▲ 0.230	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.221	▲ 0.189						
									日付	6/15	6/16	6/17	6/18	6/19
									日銀当預残	4,231,500	4,202,200	4,183,400	4,221,700	4,301,500
									準備預金残	3,658,500	3,625,100	3,605,900	3,641,400	3,709,500
									マネタリーベース	5,398,100	5,369,100	5,351,300	5,391,900	5,473,000
									無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.056%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.042%
									コール市場残高	128,996	137,385	133,558	140,088	141,571
									うち無担	109,963	118,004	113,724	120,727	121,747
									うちO/N	64,284	69,675	64,140	71,353	71,873
									うち有担	19,033	19,381	19,834	19,361	19,824

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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	応募総額(億円・百万ドル)	種別総額(億円・百万ドル)	競争レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均競争レート・利回差・価格差	競争比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/6/23			8,958	3,404	0.007		0.007	67.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2020/6/23			8,713	3,205	0.001		0.002	78.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2020/6/23			5,832	4,005	▲0.004		▲0.002	73.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/22	2020/6/23	▲ 0.350	67	67		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/22	2020/6/23	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/24	2020/7/1	0.340	158	158				

●2020年6月23日の予定

*米国5月の新築一戸建て販売件数

◆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