

Central Daily Market Report

2020年6月23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6月23日		2020年6月24日		2020年6月25日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 1,600		▲ 1,000	
財政	600		400		0	
資金過不足	▲ 900		▲ 1,200		▲ 1,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			30,000			
国債買入	10,800					
CP等買入		▲ 500		▲ 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						▲ 34,000
E T F買入	300					
国債補完供給		100				
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 28,200			
当預増減	9,800		100		▲ 35,000	
当座預金残高	4,385,400		4,385,500		4,350,500	
準備預金残高	3,774,600					
積み終了先	3,773,000		6月24日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,773,000		積数		10,400	
非準備預金先	610,800		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	99.69%	日数	26.67%		

●2020年6月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き大手行を中心に調達意欲が強く、昨日対比でレート水準は僅かに上昇した。立ち上がりは国内勢より▲0.06~▲0.03%での調達。一巡後は▲0.04%台の出合いが数件見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、月内物となるショートタームの引き合いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/N(6/24-6/25)は、▲0.070~▲0.050%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>

アウトライト市場は、短国買入オベが前回と同額の3兆円でオファーされた。平均落札利回較差+0.005%、按分落札利回較差+0.003%と、しっかりした結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.105~▲0.104%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還1,900億円に対して、少額の発行が中心であったことから発行総額は700億円弱にとどまった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/23	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				-	▲ 0.060	0.005	0.000	22,549.05	111.78	106.89-90	107.09-11
T/N							-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.040	▲ 0.059				-	▲ 0.079						
2W							-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.103	▲ 0.115						
6M							▲ 0.230	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.224	▲ 0.189						
									日付	6/16	6/17	6/18	6/19	6/22
									日銀当預残	4,202,200	4,183,400	4,221,700	4,301,500	4,375,600
									準備預金残	3,625,100	3,605,900	3,641,400	3,709,500	3,753,300
									マネタリーベース	5,369,100	5,351,300	5,391,900	5,473,000	5,547,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.056%	▲ 0.055%	▲ 0.055%	▲ 0.042%	▲ 0.045%
									コール市場残高	137,385	133,558	140,088	141,571	127,398
									うち無担	118,004	113,724	120,727	121,747	106,908
									うちO/N	69,675	64,140	71,353	71,873	61,544
									うち有担	19,381	19,834	19,361	19,824	20,490

●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
国庫短期証券買入	30,000	2020/6/24			88,909	30,003	0.003		0.005	0.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/23	2020/6/24	▲ 0.350	38	38		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/23	2020/6/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/25	2020/7/2	0.340	21,303	21,303				
米ドル資金供給		2020/6/25	2020/9/17	0.320	16,016	16,016				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	2,000	2020/6/29			6,177	2,000	0.170		0.192	33.3
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	25,000	2020/6/24	2020/7/3		12,413	12,413		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	20,000	2020/6/24	2020/9/18		15,135	15,135		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年6月24日の予定

*決定会合における意見(6月15日・16日分)	*4月の景気動向指数改訂状況
	*5月の企業向けサービス価格指数

◆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