

# Central Daily Market Report

2020年6月25日(木)

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25日		2020年6月26日		2020年6月29日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,900		▲ 1,500		0	
財政	8,800		▲ 4,500		▲ 44,000	
資金過不足	5,900		▲ 6,000		▲ 44,000	
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						▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 700		▲ 1,200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 500				2,000
新型コロナウイルス対応金融支援特別	82,800	▲ 34,000				
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100			100		
※ドル資金供給用担保提供枠				44,200		
当増減	53,400		37,100		▲ 44,300	
当座預金残高	4,437,000		4,474,100		4,429,800	
準備預金残高	3,820,200					
積み終了先	3,818,100		6月26日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,818,000		積数		7,100	
非準備預金先	616,800		1日平均		400	
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	99.79%	日数	33.33%		

## ●2020年6月25日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き大手行を含む国内勢からの調達を中心に、▲0.06~▲0.03%での出会いとなった。一巡後は▲0.04%台の出会いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は四半期末を控え、目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/26-6/29)は、▲0.065~▲0.050%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、3M物が▲0.103~▲0.098%で出合った。

### <CP市場>

CP市場は、償還総額700億円程度に対して、諸々の業態から発行が実施され、発行総額は2,500億円弱となった。発行レートは、一部の銘柄で若干低下する動きが見られたが、全体的には横ばい圏で推移した。本日実施されたCP等買入オペは、6,000億円がオファーされ、応札額13,394億円、按分レート▲0.003%という結果になった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/6/25	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	▲ 0.042				-	▲ 0.063	0.010	0.000	22,259.79	▲ 274.53	107.02-03	107.10-11
T/N							-	▲ 0.062						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.001				-	▲ 0.073						
2W			0.003				-	▲ 0.079						
3W							-	▲ 0.085						
1M			0.480				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.100	▲ 0.109						
6M							▲ 0.230	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.228	▲ 0.189						
									日付	6/18	6/19	6/22	6/23	6/24
									日銀当預残	4,221,700	4,301,500	4,375,600	4,385,400	4,383,600
									準備預金残	3,641,400	3,709,500	3,753,300	3,772,200	3,772,200
									マネタリーベース	5,391,900	5,473,000	5,547,900	5,559,200	5,559,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.042%	▲ 0.045%	▲ 0.042%	▲ 0.043%
									コール市場残高	140,088	141,571	127,398	131,467	131,580
									うち無担	120,727	121,747	106,908	110,645	111,690
									うちO/N	71,353	71,873	61,544	63,806	65,101
									うち有担	19,361	19,824	20,490	20,822	19,890

## ●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)
20年利付国債	172	0.40%	9,000	2020/6/26	2040/3/20	28,333.0	7,322.0	100.2000	0.3890%	59.9036%	100.2400	0.3860%	1,665.0

## ●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
CP等買入	6,000	2020/6/30			13,394	5,981	▲0.003		0.000	40.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/25	2020/6/26	▲ 0.350	94	94		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/25	2020/6/26	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/29	2020/7/6	0.330	200	200				

## ●2020年6月26日の予定

*6月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.2%)	*米国5月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(918回)入札 (3ヶ月、81,400億円、6/29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