

# Central Daily Market Report

2020年6月26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26日		2020年6月29日		2020年6月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 1,200			400
財政	▲ 4,800		▲ 37,400			20,300
<b>資金過不足</b>	<b>▲ 6,400</b>		<b>▲ 38,600</b>			20,700
<b>金融調節</b>	<b>スタート</b>	<b>エンド</b>	<b>スタート</b>	<b>エンド</b>	<b>スタート</b>	<b>エンド</b>
貸出						
全店共通			1,900	▲ 2,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			6,700			
CP等買入		▲ 1,200		▲ 200	6,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			2,000			
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保確保供給		44,200				
<b>当預増減</b>	<b>36,600</b>		<b>▲ 30,400</b>			26,700
当座預金残高	4,473,600		4,443,200			4,469,900
準備預金残高	3,869,700					
積み終了先	3,869,100				6月29日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,868,300				積数	2,800
非準備預金先	603,900				1日平均	200
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	99.92%	日数	43.33%		

## ●2020年6月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により大手行を中心に取り上がる動きが見られたため、前日対比でレートは上昇となった。立ち上がりは▲0.055~▲0.025%の出会い。一巡後は閑散な中、▲0.04%台の出会いが少額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、引き続き目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(6/29-6/30)は、▲0.055~▲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>

本日はTB3M物(918回)の入札が実施された。WI取引において▲0.104~▲0.095%での出会いが見られたものの、平均落札利回▲0.0946%、按分落札利回▲0.0902%と、やや甘めな結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは▲0.093%と、入札と同水準で推移した。

### <CP市場>

CP市場は、複数の業態から大型発行が実施されたものの、四半期末で償還が大量にあったことから大幅な償還超であった。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

2020/6/26	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	▲ 0.038				-	▲ 0.058	0.005	▲ 0.005	22,512.08	252.29	107.15-16	106.98-99
T/N							-	▲ 0.054						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.071						
2W							-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.081						
1M							-	▲ 0.091						
3M							▲ 0.095	▲ 0.109						
6M							▲ 0.230	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.232	▲ 0.189						
		日付	6/19	6/22	6/23	6/24	6/25							
		日銀当預残	4,301,500	4,375,600	4,385,400	4,383,600	4,437,000							
		準備預金残	3,709,500	3,753,300	3,772,200	3,772,200	3,820,200							
		マネタリーベース	5,473,000	5,547,900	5,559,200	5,559,100	5,615,400							
		無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.045%	▲0.042%	▲0.043%	▲0.042%							
		コール市場残高	141,571	127,398	131,467	131,580	128,321							
		うち無担	121,747	106,908	110,645	111,690	108,096							
		うちO/N	71,873	61,544	63,806	65,101	61,827							
		うち有担	19,824	20,490	20,822	19,890	20,225							

## ●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	918	-	81,400	2020/6/29	2020/9/28	224,529.0	66,132.6	100.0225	▲0.0902%	65.6250%	100.0236	▲0.0946%	15,267.0

## ●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	応募総額(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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2020/6/29	2020/7/13		1,900	1,900				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/6/29			10,053	3,412	0.006		0.006	59.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2020/6/29			7,795	3,201	▲0.003		▲0.001	20.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/26	2020/6/29	▲ 0.350	129	129		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/26	2020/6/29	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/30	2020/7/7	0.330	90	90				

## ●2020年6月29日の予定

*5月の商業動態統計速報
--------------

◆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