

Central Daily Market Report

2020年6月29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29日		2020年6月30日		2020年7月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 900		0	
財政	▲ 32,000		17,400		▲ 27,000	
資金過不足	▲ 33,200		16,500		▲ 27,000	
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	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		6,400			
CP等買入		▲ 200	6,000	▲ 5,800		
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					
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			1,100			
国債補完供給	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 25,100		24,300		▲ 27,000	
当座預金残高	4,448,500		4,472,800		4,445,800	
準備預金残高	3,849,800					
積み終了先	3,849,500					
超過準備	3,849,400					
非準備預金先	598,700					
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	99.93%	日数	46.67%		

●2020年6月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落した事でレート水準はやや低下したものの、引き続き参加者の調達意欲は強く、立ち上がりは▲0.06~▲0.03%での出会いとなった。一巡後は▲0.04%台の出会いが複数見られ本日の取引を終えた。ターム物は7月スタートのショートターム物で出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/30-7/1)は、▲0.095~▲0.065%程度での出会い。SCはロール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▲0.094~▲0.093%、1Y物が▲0.240~▲0.235%で出合った。

<CP市場>

発行市場は償還総額150億円程度に対して、発行総額は3,000億円程度と発行超であった。期明けのスタート日となったことで大型案件が複数見られ、活況なマーケットとなった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/29	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.060	0.010	0.005	21,995.04	▲ 517.04	107.22-24	107.19-20
T/N	▲ 0.150	▲ 0.080	▲ 0.117				-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.063	0.000	▲ 0.031				-	▲ 0.070						
2W			▲ 0.055				-	▲ 0.074						
3W							-	▲ 0.078						
1M			0.000				-	▲ 0.086						
3M			0.070				▲ 0.094	▲ 0.107						
6M							▲ 0.230	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.234	▲ 0.188						
									日付	6/22	6/23	6/24	6/25	6/26
									日銀当預残	4,375,600	4,385,400	4,383,600	4,437,000	4,473,600
									準備預金残	3,753,300	3,772,200	3,772,200	3,820,200	3,869,700
									マネタリーベース	5,547,900	5,559,200	5,559,100	5,615,400	5,653,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.045%	▲ 0.042%	▲ 0.043%	▲ 0.042%	▲ 0.038%
									コール市場残高	127,398	131,467	131,580	128,321	131,863
									うち無担	106,908	110,645	111,690	108,096	111,168
									うちO/N	61,544	63,806	65,101	61,827	66,389
									うち有担	20,490	20,822	19,890	20,225	20,695

●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)	募入最低値	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	実行利率	申込総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	授付レート・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	授付比率
国債買入(残存期間1年以下)	800	2020/6/30			2,039	802	0.004		0.009	60.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2020/6/30			10,122	4,011	0.001		0.002	35.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/6/30			4,727	1,222	0.003		0.003	42.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/29	2020/6/30	▲ 0.350	53	53		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/29	2020/6/30	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/1	2020/7/8	0.330	93	93				

●2020年6月30日の予定

*5月の完全失業率(市場予想:2.8%)	*米国4月のS&Pケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(30,000億円、7/1発行)
*5月の有効求人倍率(市場予想:1.23倍)	*米国6月のCB消費者信頼感指数	
*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲5.7%)	*米国6月のシカゴPM景況感指数	
*5月の住宅着工統計	*ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値	
	*英国1-3月期のGDP確報値	

◆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