

# Central Daily Market Report

2020年6月30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30日		2020年7月1日		2020年7月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 700			0
財政	17,200		▲ 27,800		▲ 28,000	
資金過不足	16,300		▲ 28,500		▲ 28,000	
<b>金融調節</b>						
	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	6,400					
CP等買入	6,000	▲ 5,800		▲ 100		
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	1,100		100			
国債補完供給	▲ 2,400	100		2,400		
※ドル資金供給用担保債供給			▲ 4,000			
当預増減	21,700		▲ 100		▲ 28,000	
当座預金残高	4,470,200		4,470,100		4,442,100	
準備預金残高	3,868,000					
積み終了先	3,867,900					
超過準備	3,866,700					
非準備預金先	602,200					
7月1日以降の残り所要積立額						
積数					1,100	
1日平均					100	
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	99.97%	日数	50.00%		

## ●2020年6月30日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.087~▲0.05%での出合いとなった。四半期末を跨ぐ取引となるため調達を控える先も多く、レート水準は大幅に低下した。一巡後は▲0.07%台で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は7月スタートとなるショートターム物の引き合いが複数見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(7/1-7/2)は、▲0.085~▲0.070%程度での出合い。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、短国買入オペアが前回と同額の3兆円でオファーされた。平均落札利回較差+0.006%、按分落札利回較差+0.006%と、しっかりした結果となった。TB6M物やTB1Y物(前回債)が対象銘柄から除外されたためか、応札額はやや少なかった。マーケットでは、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

発行市場は償還総額750億円程度に対して、発行総額は2,400億円程度と発行超であった。大型案件が複数見られ、月初としてはやや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

2020/6/30	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.062	0.025	0.015	22,288.14	293.10	107.58-59	107.72-73
T/N							-	▲ 0.073						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.040	▲ 0.059				-	▲ 0.071						
2W	▲ 0.005	0.010	▲ 0.002				-	▲ 0.073						
3W							-	▲ 0.079						
1M	▲ 0.060	▲ 0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.087						
3M							▲ 0.094	▲ 0.106						
6M							▲ 0.230	▲ 0.163						
1Y							▲ 0.234	▲ 0.188						
									日付	6/23	6/24	6/25	6/26	6/29
									日銀当預残	4,385,400	4,383,600	4,437,000	4,473,600	4,448,500
									準備預金残	3,772,200	3,772,200	3,820,200	3,869,700	3,849,800
									マネタリーベース	5,559,200	5,559,100	5,615,400	5,653,600	5,629,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.042%	▲ 0.043%	▲ 0.042%	▲ 0.038%	▲ 0.041%
									コール市場残高	131,467	131,580	128,321	131,863	126,174
									うち無担	110,645	111,690	108,096	111,168	105,131
									うちO/N	63,806	65,101	61,827	66,389	61,812
									うち有担	20,822	19,890	20,225	20,695	21,043

## ●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)
2年利付国債	414	0.10%	30,000	2020/7/1	2022/7/1	113,900.0	24,322.00	100.4650	▲0.1310%	60.4829%	100.4740	▲0.1360%	5,673.0

## ●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
国庫短期証券買入	30,000	2020/7/1			76,867	30,003	0.006		0.006	82.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/30	2020/7/1	▲ 0.350	2,420	2,420		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/30	2020/7/1	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/7/2	2020/7/9	0.320	21,182	21,182				
米ドル資金供給		2020/7/2	2020/9/25	0.310	6,372	6,372				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/7/1	2020/7/10		2,385	2,385		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/7/1	2020/9/28		1,559	1,559		▲ 0.100	▲ 0.100	

## ●2020年7月1日の予定

\*6月調査の日銀短観(概要及び要旨)  
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：▲31  
\*6月の消費動向調査

\*米国5月の建設支出  
\*米国6月のISM製造業景況指数

◆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