

Central Daily Market Report

2020年6月24日(水)
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24日		2020年6月25日		2020年6月26日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,700		▲ 2,700		▲ 2,000	
財政	▲ 1,400		8,000		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 3,100		5,300		▲ 4,000	
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						
CP等買入		▲ 500		▲ 700		
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		
新型コロナ対応金融支援特別			82,800	▲ 34,000		
E T F買入						
国債補充供給						43,300
米ドル資金供給用担保提供供給	▲ 28,200					
当預増減	▲ 1,800		52,900		39,300	
当座預金残高	4,383,600		4,436,500		4,475,800	
準備預金残高	3,772,200					
積み終了先	3,771,100				6月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,771,100				積数	9,300
非準備預金先	611,400				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	99.72%	日数	30.00%		

●2020年6月24日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は邦銀を中心に▲0.06～▲0.03%の出会いとなった。引き続き大手行を中心に資金調達意欲は強く、前日から横ばい圏での推移。一巡後は閑散な状況のなか、▲0.04%台で散発的な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、月内の期日物を中心に出会いが数件見られた。

＜レポ市場＞

GC T/N(6/25-6/26)は、▲0.065～▲0.055%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▲0.104%で出合った。

＜CP市場＞

CP市場は、償還1,000億円に対して、複数の業態から調達が実施され、発行総額1,800億円と発行超であった。発行レートは、一部の銘柄で積極的な応札が見られたものの、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/24	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	▲ 0.043				-	▲ 0.061	0.010	0.005	22,534.32	▲ 14.73	106.41-43	106.59-61
T/N							-	▲ 0.060						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.073						
2W			0.080				-	▲ 0.079						
3W							-	▲ 0.085						
1M							-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.104	▲ 0.111						
6M							▲ 0.230	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.226	▲ 0.189						
									日付	6/17	6/18	6/19	6/22	6/23
									日銀当預残	4,183,400	4,221,700	4,301,500	4,375,600	4,385,400
									準備預金残	3,605,900	3,641,400	3,709,500	3,753,300	3,772,200
									マネタリーベース	5,351,300	5,391,900	5,473,000	5,547,900	5,559,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.055%	▲ 0.042%	▲ 0.045%	▲ 0.042%
									コール市場残高	133,558	140,088	141,571	127,398	131,467
									うち無担	113,724	120,727	121,747	106,908	110,645
									うちO/N	64,140	71,353	71,873	61,544	63,806
									うち有担	19,834	19,361	19,824	20,490	20,822

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/24	2020/6/25	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/24	2020/6/25	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/26	2020/7/6	0.330	100	100				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2020/6/25	2020/12/25	0	82,784

●2020年6月25日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報	*米国1-3月期のGDP確報値 *米国5月の耐久財新規受注	*20年利付国債入札 (9,000億円、6/26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