

Central Daily Market Report

2020年6月12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12日		2020年6月15日		2020年6月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 100			0
財政	▲ 3,500		22,900		▲ 33,000	
資金過不足	▲ 4,400		22,800		▲ 33,000	
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	▲ 4,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	30,000					
国債買入			7,000			
CP等買入		▲ 700		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	500	▲ 900				
社債等買入		▲ 700	3,000			
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入	100					
国債補充供給	▲ 300	500		300		
米ドル資金供給(信用保証提供)		9,500				
当増減	33,600		30,900		▲ 33,000	
当座預金残高	4,199,700		4,230,600		4,197,600	
準備預金残高	3,629,100					
積み終了先	3,629,100		6月15日以降の残リ所要積立額			
超過準備	3,628,900		積数		0	
非準備預金先	570,600		1日平均		0	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,399,300	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%		

●2020年6月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日に向けた調整の動きに週末要因が重なり、今積み期間で最も高い水準での取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態などから▲0.025~▲0.015%での調達。一巡後はレートがやや低下し、▲0.04~▲0.03%近辺での出合いが中心となった。ターム物は、来積み期スタートの1~2W物のショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(6/15-6/16)は、▲0.06~▲0.04%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、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日は、TB3M物(914回)の入札が実施された。WI取引において▲0.101~▲0.100%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1018%、按分落札利回▲0.0982%と無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.1175~▲0.110%出合いと堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件2件のみと少なく、償還総額400億円程度に対し、発行総額150億円程度と閑散なマーケットとなった。発行レートは全般的に、昨日に引続き、若干低めの水準で推移した。本日はCP等買入オベが、6,000億円度オファーされた。結果は、平均落札レート▲0.006%、按分落札レート▲0.01%と、前回(平均▲0.005%、按分▲0.017%)比で按分レートがさらに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/12	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	▲ 0.023				-	▲ 0.059	0.010	0.005	22,305.48	▲ 167.43	106.80-81	107.20-22
T/N			▲ 0.050				-	▲ 0.054						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.001	▲ 0.043				-	▲ 0.071						
2W	▲ 0.068	0.000	▲ 0.053				-	▲ 0.081						
3W							-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.120	▲ 0.122						
6M							▲ 0.179	▲ 0.162						
1Y							▲ 0.218	▲ 0.187						
									日付	6/5	6/8	6/9	6/10	6/11
									日銀当預残	4,169,900	4,140,200	4,154,700	4,156,800	4,166,100
									準備預金残	3,583,700	3,569,500	3,580,200	3,581,000	3,600,000
									マネタリーベース	5,334,200	5,304,100	5,318,900	5,321,100	5,331,600
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.055%	▲0.048%	▲0.038%	▲0.031%
									コール市場残高	153,789	142,483	140,077	132,583	130,102
									うち無担	135,147	124,046	121,033	113,058	111,675
									うちO/N	84,513	74,032	71,014	65,544	63,311
									うち有担	18,642	18,437	19,044	19,525	18,427

●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・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	914	-	91,400	2020/6/15	2020/9/14	230,443.0	74,368.30	100.0245	▲0.0982%	32.1561%	100.0254	▲0.1018%	17,031.0
エネルギー対策	-	-	7,500	2020/6/22	2021/6/21	172,500.0	7,499.83		0.0000%	4.3478%		0.0000%	

●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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2020/6/15	2020/6/29		2,250	2,250				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/6/15			11,716	3,403	0.003		0.004	51.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2020/6/15			10,226	3,206	▲0.001		0.000	79.6
国債買入(物価連動債)	300	2020/6/15			1,117	301	▲0.270		▲0.324	8.2
CP等買入	6000	2020/6/17			12,864	5,980	▲0.010		▲0.006	60.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/12	2020/6/15	▲ 0.350	291	291		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/12	2020/6/15	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/16	2020/6/23	0.350	0	0				

●2020年6月15日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、16日まで)	*国庫短期証券(915回)入札(6ヶ月、28,000億円、6/16発行)
*4月の第3次産業活動指数	*流動性供給入札(5,000億円、6/16発行)
*4月の石油等消費動態統計	

◆本資料は信頼できるとさ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