

# Central Daily Market Report

2020年6月15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15日		2020年6月16日		2020年6月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 200		▲ 1,000	
財政	24,000		▲ 26,000		1,000	
資金過不足	23,800		▲ 26,200		0	
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						
国債買入	7,000					
CP等買入		▲ 500		▲ 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	3,000					
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保買付供給						
当預増減	31,800		▲ 26,300		6,000	
当座預金残高	4,231,500		4,205,200		4,211,200	
準備預金残高	3,658,500					
積み終了先	3,658,500					6月16日以降の残り所要積立額
超過準備	3,658,500					積数 3,320,800
非準備預金先	573,000					1日平均 110,700
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		0.00%		日数	0.00%

## ●2020年6月15日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日にあたり資金調達意欲が強く、前営業日に比べ更に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▲0.02~▲0.015%での調達。一巡後はレートがやや低下し、▲0.05~▲0.02%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(6/16-6/17)は、▲0.08~▲0.06%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>

本日は、TB6M物(915回)の入札が実施された。WI取引において▲0.170%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1753%、按分落札利回▲0.1733%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、▲0.185~▲0.180%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.120%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還総額750億円程度に対して、発行総額1,100億円程度となった。石油・食品等からまとまった発行が実施された。発行レートは前回の買入オペの結果を受けてか、全体的に若干の上昇傾向が見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2020/6/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.093	0.000	▲ 0.010	21,530.95	▲ 774.53	107.31-33	107.35-36		
T/N							-	▲ 0.072								
S/N							-	-								
1W							-	▲ 0.080			日付	6/8	6/9	6/10	6/11	6/12
2W	▲ 0.065	▲ 0.020	▲ 0.040				-	▲ 0.084			日銀当預残	4,140,200	4,154,700	4,156,800	4,166,100	4,199,700
3W							-	▲ 0.095			準備預金残	3,569,500	3,580,200	3,581,000	3,600,000	3,629,100
1M							-	▲ 0.108			マネタリーベース	5,304,100	5,318,900	5,321,100	5,331,600	5,366,100
3M							▲ 0.117	▲ 0.123			無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.048%	▲ 0.038%	▲ 0.031%	▲ 0.023%
6M							▲ 0.189	▲ 0.164			コール市場残高	142,483	140,077	132,583	130,102	138,658
1Y							▲ 0.218	▲ 0.187			うち無担	124,046	121,033	113,058	111,675	119,805
											うちO/N	74,032	71,014	65,544	63,311	70,796
											うち有担	18,437	19,044	19,525	18,427	18,853

## ●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	915	-	28,000	2020/6/16	2020/12/16	103,657.0	23,001.9	100.0870	▲0.1733%	91.4545%	100.0880	▲0.1753%	4,998.0
流動性供給	312	-	5,000	2020/6/16		16,367.0	4,987.0		▲0.0050%	9.2220%		▲0.0070%	

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/15	2020/6/16	▲ 0.350	129	129		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/15	2020/6/16	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/17	2020/6/24	0.340	170	170				

## ●2020年6月16日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	*米国4月の企業在庫
*黒田日銀総裁、定例会見	*米国5月の小売売上高
	*米国5月の鉱工業生産・設備稼働率

◆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