

# Central Daily Market Report

2020年6月17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17日		2020年6月18日		2020年6月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 2,200		▲ 1,000	
財政	▲ 200		4,100		▲ 23,000	
資金過不足	▲ 1,300		1,900		▲ 24,000	
<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			7,800			
CP等買入	6,000	▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					63,200	▲ 62,000
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	200					
国債補完供給	▲ 300	600		300		
※ドル資金供給用担保提供	▲ 23,700					84,500
当預増減	▲ 18,800		39,600		61,700	
当座預金残高	4,183,400		4,223,000		4,284,700	
準備預金残高	3,605,900					
積み終了先	3,494,200		6月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,034,600		積数		92,000	
非準備預金先	577,500		1日平均		3,300	
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	97.23%	日数	6.67%		

## ●2020年6月17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~▲0.04%の出会いとなった。一部業態では取り上げる動きが見られたものの、様子見の先も多く、全体としては概ね横這いでの推移となった。一巡後は▲0.075~▲0.06%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。ターム物は引き続き月内物では資金運用ニーズが強く、▲0.08~▲0.06%の出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/N(6/18-6/19)は、▲0.085~▲0.07%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、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+0.003%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.117~▲0.116%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、五・十日の前倒し発行が見られ、石油業態等から大型発行が実施されたが、償還総額2,300億円弱に対して、発行総額1,550億円程度にとどまる償還超となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移したが、一部で目線を若干切り下げる動きが観測された。

## ●短期金融市場関連指標

2020/6/17	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	▲ 0.055				-	▲ 0.069	0.015	0.000	22,455.76	▲ 126.45	107.39-41	107.34-36
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.080	0.040	▲ 0.052				-	▲ 0.082						
2W							-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.093						
1M							-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.117	▲ 0.120						
6M							▲ 0.196	▲ 0.165						
1Y							▲ 0.235	▲ 0.187						
									日付	6/10	6/11	6/12	6/15	6/16
									日銀当預残	4,156,800	4,166,100	4,199,700	4,231,500	4,202,200
									準備預金残	3,581,000	3,600,000	3,629,100	3,658,500	3,625,100
									マネタリーベース	5,321,100	5,331,600	5,366,100	5,398,100	5,369,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.038%	▲ 0.031%	▲ 0.023%	▲ 0.018%	▲ 0.056%
									コール市場残高	132,583	130,102	138,658	128,996	137,385
									うち無担	113,058	111,675	119,805	109,963	118,004
									うちO/N	65,544	63,311	70,796	64,284	69,675
									うち有担	19,525	18,427	18,853	19,033	19,381

## ●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非償額競争入札(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
国庫短期証券買入	30,000	2020/6/18			62,748	30,002	0.003		0.006	20.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/6/18			11,762	3,401	0.002		0.003	70.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2020/6/18			8,202	4,005	▲ 0.003		▲ 0.003	90.4
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/6/18			1,287	304	0.011		0.012	23.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/17	2020/6/18	▲ 0.350	321	321		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/17	2020/6/18	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/19	2020/6/26	0.340	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2020/6/19	2024/6/19	0	63,179

## ●2020年6月18日の予定

\*英中銀MPC結果発表

\*国庫短期証券(916回)入札(1年、30,000億円、6/22発行)

\*5年利付国債入札(19,000億円、6/19発行)

◆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