

Central Daily Market Report

2020年6月18日(木)
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18日		2020年6月19日		2020年6月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,300		▲ 1,200			0
財政	3,300		▲ 18,400			32,000
資金過不足	1,000		▲ 19,600			32,000
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	7,800					
CP等買入		▲ 400		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			63,200	▲ 49,100		
被災地支援						
社債等買入				▲ 800		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			100			
国債補完供給	▲ 400	300		400		
米ドル資金供給用担保資産供給				85,800		
当預増減	38,300		79,300			32,000
当座預金残高	4,221,700		4,301,000			4,333,000
準備預金残高	3,641,400					
積み終了先	3,612,300				6月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,587,100				積数	37,600
非準備預金先	580,300				1日平均	1,400
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	98.87%	日数	10.00%		

●2020年6月18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。昨日同様に一部の先では取り上がる動きが見られたものの、全般的には横ばい圏の推移となった。一巡後は▲0.08~▲0.055%の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いものの、調達意欲は限定的で▲0.075~▲0.06%の出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/19-6/22)は、▲0.090~▲0.075%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>

本日はTB1Y物(916回)の入札が実施された。WI取引において▲0.186~▲0.180%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1961%、按分落札利回▲0.1931%としっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.213~▲0.210%出会いと堅調な推移となった。この他に3M物が▲0.120~▲0.119%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、600億円程度の償還総額に対して、700億円の発行総額となり、化学等から大型発行が見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2020/6/18	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				-	▲ 0.079	0.010	▲ 0.005	22,355.46	▲ 100.30	106.87-88	106.96-98
T/N							-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.082						
2W							-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.104						
3M							▲ 0.125	▲ 0.118						
6M							▲ 0.195	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.213	▲ 0.185						
									日付	6/11	6/12	6/15	6/16	6/17
									日銀当預残	4,166,100	4,199,700	4,231,500	4,202,200	4,183,400
									準備預金残	3,600,000	3,629,100	3,658,500	3,625,100	3,605,900
									マネタリーベース	5,331,600	5,366,100	5,398,100	5,369,100	5,351,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.031%	▲ 0.023%	▲ 0.018%	▲ 0.056%	▲ 0.055%
									コール市場残高	130,102	138,658	128,996	137,385	133,558
									うち無担	111,675	119,805	109,963	118,004	113,724
									うちO/N	63,311	70,796	64,284	69,675	64,140
									うち有担	18,427	18,853	19,033	19,381	19,834

●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	916	-	30,000	2020/6/22	2021/6/21	107,809.0	24,342.80	100.1930	▲0.1931%	16.9653%	100.1960	▲0.1961%	5,657.0
5年利付国債	143	0.10%	19,000	2020/6/19	2025/3/20	58,375.0	15,411.00	101.0400	▲0.1170%	37.4921%	101.0500	▲0.1190%	3,552.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/18	2020/6/19	▲ 0.350	73	73		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/18	2020/6/19	▲ 0.350	303	303		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/6/22	2020/6/29	0.340	0	0				

●2020年6月19日の予定

*日銀金融政策決定会合議事要旨(4月27日分)	*月例経済報告	*国庫短期証券(917回)入札
*日銀金融政策決定会合議事要旨(5月22日分)	*5月の全国消費者物価指数(CPI)	(3ヶ月、81,400億円、6/22発行)
	市場予想：前年同月比(除く生鮮)▲0.1%	

◆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