

Central Daily Market Report

2020年6月16日(火)
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16日		2020年6月17日		2020年6月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 28,300		1,800		2,000	
資金過不足	▲ 28,600		700		1,000	
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 200	6,000	▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
ETF買入			200			
国債補完供給	▲ 600	100		600		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 23,700			
当預増減	▲ 29,300		▲ 16,500		1,000	
当座預金残高	4,202,200		4,185,700		4,186,700	
準備預金残高	3,625,100					
積み終了先	2,316,400		6月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	968,200		積数		664,000	
非準備預金先	577,100		1日平均		22,900	
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	80.00%	日数	3.33%		

●2020年6月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.06~▲0.04%の出合いが中心となった。新しい積み期間に入り、調達を控えた先も多く、昨日に比べレート水準は低下した。一巡後は▲0.08~▲0.06%の出合いが散見され本日の取引を終えた。ターム物は月中物を中心に資金運用ニーズが強く、▲0.07~▲0.05%の出合いが複数見られた。金融政策決定会合では、現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/N(6/17-6/18)は、▲0.06~▲0.05%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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.1175%、6M物が▲0.204~▲0.200%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額900億円強に対し、発行総額は400億円強にとどまり、小口の発行案件が中心となった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●2020年6月17日の予定

*5月の貿易統計
*米国5月の住宅着工件数
*ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値
*英国5月の消費者物価指数

●短期金融市場関連指標

2020/6/16	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	売買参考統計値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.056					-	▲ 0.054	0.015	0.015	22,582.21	1,051.26	107.48-49	107.32-33
T/N								-	▲ 0.053						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.005	▲ 0.057					-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.065	0.030	▲ 0.056					-	▲ 0.082						
3W								-	▲ 0.092						
1M								-	▲ 0.104						
3M								▲ 0.119	▲ 0.120						
6M								▲ 0.205	▲ 0.164						
1Y								▲ 0.232	▲ 0.187						
										日付	6/9	6/10	6/11	6/12	6/15
										日銀当預残	4,154,700	4,156,800	4,166,100	4,199,700	4,231,500
										準備預金残	3,580,200	3,581,000	3,600,000	3,629,100	3,658,500
										マネタリーベース	5,318,900	5,321,100	5,331,600	5,366,100	5,398,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.038%	▲ 0.031%	▲ 0.023%	▲ 0.018%
										コール市場残高	140,077	132,583	130,102	138,658	128,996
										うち無担	121,033	113,058	111,675	119,805	109,963
										うちO/N	71,014	65,544	63,311	70,796	64,284
										うち有担	19,044	19,525	18,427	18,853	19,033

●入札結果

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)	残札総額 (億円・ 百万ドル)	競争レート ・利回差 ・価格差	全取レート ・利回差 ・価格差	平均落札レート ・利回差 ・価格差	競争 比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/16	2020/6/17	▲ 0.35	458	458		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/16	2020/6/17	▲ 0.350	134	134		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/6/18	2020/6/25	0.350	23,114	23,114				
米ドル資金供給		2020/6/18	2020/9/11	0.340	17,044	17,044				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	25,000	2020/6/17	2020/6/26		14,390	14,390		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	20,000	2020/6/17	2020/9/14		8,821	8,821		▲ 0.100	▲ 0.100	

●金融政策決定会合・結果

●現行の金融市場調節方針を維持することを賛成多数で決定。 (1)長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1) 短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。 長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。 その際、金利は、経済・物価情勢等に応じて上下にある程度変動しうるものとする。(金利が急速に上昇する場合には、迅速かつ適切に国債買入れを実施する。) (2)資産買入れ方針(全員一致)(長期国債以外の資産の買入れについて) ①ETFおよびJ-REITについて、当面は、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、積極的な買入れを行う。 (ETFおよびJ-REITの原則的な買入れ方針としては、引き続き、保有残高が、それぞれ年間約6兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行い、その際、資産価格のプレミアムへの働きかけを適切に行う観点から、市場の状況に応じて、買入れ額は上下に変動しうるものとする。) ②CP等、社債等については、それぞれ約2兆円、約3兆円の残高を維持する。これに加え、2021年3月末までの間、それぞれ7.5兆円の残高を上限に、追加の買入れを行う。
--

◆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