Central Daily Market Report

2020年6月1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1日 需給速報		2020年6月2日 需給予想		2020年6月3日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 800		1,000	
財政	▲ 74,900		▲ 24,200		▲ 66,000	
資金過不足	▲ 75,100		▲ 25,000		▲ 65,000	
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	8,700		4,000			
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成)					2,000	▲ 6,100
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 700	100		700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 67,000		▲ 20,500		▲ 69,100	

当座預金残高	4,204,400	4,183,900	4,114,800
準備預金残高	3,634,400		
積み終了先	3,634,000		
超過準備	3,634,000		
非準備預金先	570,000		

6月2日以降の残り所要積立額	
積数	3,400
1日平均	200

積み期間（5/16～6/15）の所要準備額			3,360,900
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数 54.84%

●2020年6月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、月末の調達を控えていた参加者が復活したため、前営業日と比べて高い水準での取引となった。立ち上がりは都銀・信託業態から▲0.07～▲0.055%、地銀・外銀業態などから▲0.08～▲0.05%での調達となった。一巡後は▲0.08～▲0.06%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、1～2W物のショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(6/2-6/3)は、▲0.100～▲0.08%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2Y402～412、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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.105%、6M物が▲0.195%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は200億円程度、発行総額は少額と閑散。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/1	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.058				－	▲ 0.097
T/N			▲ 0.080				－	▲ 0.096
S/N							－	－
1W	▲ 0.065	▲ 0.030	▲ 0.056				－	▲ 0.099
2W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.057				－	▲ 0.100
3W			▲ 0.080				－	▲ 0.102
1M							－	▲ 0.108
3M							▲ 0.105	▲ 0.121
6M							▲ 0.196	▲ 0.164
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.005	0.005	22,062.39	184.50	107.71-72	107.52-53

日付	5/25	5/26	5/27	5/28	5/29
日銀当預残	4,180,700	4,206,800	4,242,000	4,252,100	4,271,400
準備預金残	3,603,800	3,628,600	3,648,500	3,660,100	3,681,900
マネタリーベース	5,339,800	5,366,700	5,402,500	5,414,200	5,434,300
無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.060%	▲0.059%	▲0.057%	▲0.073%
コール市場残高	136,954	137,582	143,574	142,058	137,926
うち無担	116,885	119,629	122,911	124,026	120,286
うちO/N	70,456	72,680	74,652	75,327	75,002
うち有担	20,069	17,953	20,663	18,032	17,640

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ｉ非価格競争入札（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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,400	2020/6/2			8,299	3,405	▲0.002		0.000	96.7
国債買入（残存期間25年超）	300	2020/6/2			1,312	302	0.013		0.014	46.6
国債買入（物価連動債）	300	2020/6/2			1,348	301	▲0.170		▲0.226	37.5
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/6/1	2020/6/2	▲ 0.350	702	702		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/6/1	2020/6/2	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/3	2020/6/10	0.300	172	172				

●2020年6月2日の予定

*5月実績/6月見込み財政資金対民間収支
*5月のマネタリーベース
*10年利付国債入札
（21,000億円、6/3発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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