

# Central Daily Market Report

2020年6月2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2日		2020年6月3日		2020年6月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 900		0		0	
財政	▲ 24,800		▲ 46,200		2,000	
資金過不足	▲ 25,700		▲ 46,200		2,000	
<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	4,000					
CP等買入		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金(成)			2,000	▲ 4,500		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
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	700		400		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 1,000			
当増減	▲ 21,600		▲ 19,600		2,000	
当座預金残高	4,182,800		4,163,200		4,165,200	
準備預金残高	3,609,900					
積み終了先	3,609,700		6月3日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,609,700		積数	3,100		
非準備預金先	572,900		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	99.91%	日数	58.06%		

## ●2020年6月2日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き大手行からまとまった量のビッドが入る一方で、様子見姿勢の先も多く、全体としては横ばいとなった。立ち上がりは都銀・信託業態から▲0.065~▲0.06%、地銀・外銀業態などから▲0.08~▲0.05%での調達。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(6/3-6/4)は、▲0.110~▲0.09%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>

本日は短国買入オベが前回から10,000億円増額の30,000億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差0.000%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▲0.108%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、償還が見られなかった一方で、電気機器業態で大型発行があり、発行総額は1,300億円程度となった。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

2020/6/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.059				-	▲ 0.098	0.005	0.000	22,325.61	263.22	107.55-57	107.78-79		
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.110								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.070	▲ 0.060	▲ 0.066				-	▲ 0.103								
2W	▲ 0.070	▲ 0.010	▲ 0.061				-	▲ 0.103								
3W							-	▲ 0.105								
1M							-	▲ 0.110								
3M							▲ 0.107	▲ 0.123								
6M							▲ 0.198	▲ 0.164								
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188								
											日付	5/26	5/27	5/28	5/29	6/1
											日銀当預残	4,206,800	4,242,000	4,252,100	4,271,400	4,204,400
											準備預金残	3,628,600	3,648,500	3,660,100	3,681,900	3,634,400
											マネタリーベース	5,366,700	5,402,500	5,414,200	5,434,300	5,367,400
											無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.059%	▲0.057%	▲0.073%	▲0.058%
											コール市場残高	137,582	143,574	142,058	137,926	150,042
											うち無担	119,629	122,911	124,026	120,286	129,682
											うちO/N	72,680	74,652	75,327	75,002	82,478
											うち有担	17,953	20,663	18,032	17,640	20,360

## ●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)
10年利付国債	358	0.10%	21,000	2020/6/3	2030/3/20	57,270.0	17,020.0	100.9600	0.0010%	86.4694%	100.9800	0.0000%	3,969.0

## ●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
国庫短期証券買入	30,000	2020/6/3			49,473	30,004	0.000		0.003	44.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/2	2020/6/3	▲ 0.350	389	389		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/2	2020/6/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/4	2020/6/11	0.300	2,747	2,747				
米ドル資金供給		2020/6/4	2020/8/27	0.300	1,355	1,355				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/6/3	2020/8/28		947	947		▲ 0.100	▲ 0.100	

## ●2020年6月3日の予定

\*6月の日銀当座預金増減要因見込み

\*米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫

\*米国5月のISM非製造業景況指数

◆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