

# Central Daily Market Report

2020年6月3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3日		2020年6月4日		2020年6月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100	▲ 600				0
財政	▲ 44,700		2,600		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 44,600		2,000		▲ 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			6,500			
CP等買入		▲ 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	▲ 200	400		200		
米ドル資金供給用担保提供供給	▲ 1,000					
当増減	▲ 18,200		8,600		▲ 2,000	
当座預金残高	4,164,600		4,173,200		4,171,200	
準備預金残高	3,595,600					
積み終了先	3,595,200		6月4日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,595,200		積数	2,700		
非準備預金先	569,000		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	99.92%	日数	61.29%		

## ●2020年6月3日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、ビッドサイドの参加者が減少したため、前日に比べて低いレートでの取引となった。立ち上がりは都銀業態から▲0.08~▲0.07%、地銀・外銀業態などから▲0.08~▲0.06%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見られた。

### <レポ市場>

GC T/N(6/4-6/5)は、▲0.105~▲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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.108%、6M物が▲0.196%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、鉄鋼・石油業態で大型発行があり、発行・償還総額ともに1,200億円程度となった。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

2020/6/3	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)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.097	0.010	0.005	22,613.76	288.15	108.82-84	108.74-75
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.101						
2W							-	▲ 0.103						
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.108	▲ 0.123						
6M							▲ 0.198	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188						
									日付	5/27	5/28	5/29	6/1	6/2
									日銀当預残	4,242,000	4,252,100	4,271,400	4,204,400	4,182,800
									準備預金残	3,648,500	3,660,100	3,681,900	3,634,400	3,609,900
									マネタリーベース	5,402,500	5,414,200	5,434,300	5,367,400	5,346,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.057%	▲ 0.073%	▲ 0.058%	▲ 0.059%
									コール市場残高	143,574	142,058	137,926	150,042	149,841
									うち無担	122,911	124,026	120,286	129,682	130,723
									うちO/N	74,652	75,327	75,002	82,478	80,959
									うち有担	20,663	18,032	17,640	20,360	19,118

## ●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1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	応募総額(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年以下)	800	2020/6/4			2,125	805	0.005		0.006	75.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2020/6/4			8,118	3,206	0.007		0.008	37.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/6/4			4,142	1,210	0.007		0.008	44.4
国債買入(変動利付債)	1,000	2020/6/4			1,997	1,005	▲ 0.280		▲ 0.295	38.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/3	2020/6/4	▲ 0.350	214	214		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/3	2020/6/4	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/5	2020/6/12	0.300	0	0				

## ●2020年6月4日の予定

*米国4月の貿易収支	*ECB定例理事会	*30年利付国債入札(7,000億円、6/5発行)
		*交付税特別会計借入(21,000億円、6/12借入)

◆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