

Central Daily Market Report

2020年6月4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4日		2020年6月5日		2020年6月8日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		100		1,000	
財政	900		100		▲ 44,000	
資金過不足	400		200		▲ 43,000	
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	6,500					
CP等買入				▲ 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		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入			1,000			
国債補完供給	▲ 500	200		500		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	6,500		1,400		▲ 43,000	
当座預金残高	4,171,100		4,172,500		4,129,500	
準備預金残高	3,590,900					
積み終了先	3,590,500		6月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,590,500		積数		2,300	
非準備預金先	580,200		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	99.93%	日数	64.52%		

●2020年6月4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若干増加し、前日と比べて高いレートでの取引となった。立ち上がりは都銀・信託業態から▲0.07~▲0.065%、地銀・外銀業態などから▲0.07~▲0.06%での調達が見られた。一巡後は▲0.08~▲0.06%近辺で散發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(6/5-6/8)は、▲0.105~▲0.095%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%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は、医薬品業態で大型発行があり、償還総額は300億円程度に対し、発行総額は550億円程度。発行レートは、引き続き低位で推移した。本日はCP等買入オペアが、6,000億円でオファーされた。平均落札レート▲0.005%、按分レート▲0.017%と、前回比(平均▲0.020%・按分▲0.027%)で上昇した。

●短期金融市場関連指標

2020/6/4	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	売買差	平均値	直近値	前日比	15時時点
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.098	0.025	0.015	22,695.74	81.98	108.99-00	109.06-08
T/N							-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.070				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.108	▲ 0.124						
6M							▲ 0.198	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188						
									日付	5/28	5/29	6/1	6/2	6/3
									日銀当預残	4,252,100	4,271,400	4,204,400	4,182,800	4,164,600
									準備預金残	3,660,100	3,681,900	3,634,400	3,609,900	3,595,700
									マネタリーベース	5,414,200	5,434,300	5,367,400	5,346,700	5,328,500
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.073%	▲0.058%	▲0.059%	▲0.068%
									コール市場残高	142,058	137,926	150,042	149,841	146,084
									うち無担	124,026	120,286	129,682	130,723	127,334
									うちO/N	75,327	75,002	82,478	80,959	78,270
									うち有担	18,032	17,640	20,360	19,118	18,750

●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)
30年利付国債	66	0.40%	7,000	2020/6/5	2050/3/20	16,097.0	5,685.0	96.5500	0.5340%	33.7612%	96.6600	0.5290%	1,335.0
交付税特会	-	-	21,000	2020/6/12	2020/12/11	344,373.0	21,000.04		0.0000%	6.0981%		0.0000%	

●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
CP等買入	6,000	2020/6/9			13,780	6,000	▲0.017		▲0.005	3.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/4	2020/6/5	▲0.350	507	507		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/4	2020/6/5	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/8	2020/6/15	0.310	0	0				

●2020年6月5日の予定

*4月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比▲15.4%)	*米国5月の雇用統計 *米国4月の消費者信用残高	*国庫短期証券(912回)入札 (3ヶ月、91,400億円、6/8発行)
*4月の景気動向指数速報		
*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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