

Central Daily Market Report

2020年6月5日(金)

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5日		2020年6月8日		2020年6月9日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		300		1,000	
財政	▲ 2,200		▲ 39,400		10,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 39,100		11,000	
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			10,900			
CP等買入		▲ 300		▲ 200	6,000	
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						
E T F 買入	1,000					
国債補完供給	▲ 300	500		300		
※ドル資金供給用担保債供給						
当預増減	▲ 1,200		▲ 28,100		17,000	
当座預金残高	4,169,900		4,141,800		4,158,800	
準備預金残高	3,583,700					
積み終了先	3,583,500		6月8日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,583,400		積数	1,600		
非準備預金先	586,200		1日平均	200		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					3,399,300	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	74.19%		

●2020年6月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により取り上がる先が見られたため、前日に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▲0.06~▲0.055%、地銀・外銀業態などから▲0.07~▲0.045%での調達が見られた。一巡後は▲0.08~▲0.05%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(6/8-6/9)は、▲0.095~▲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>

本日はTB3M物(912回)の入札が実施された。WI取引において▲0.104~▲0.101%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.0986%、按分落札利回▲0.0922%と、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.101~▲0.095%出合いで推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、電気機器・不動産・食料品業態で大型発行があり、償還総額は500億円程度に対し、発行総額は1,700億円程度となった。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

2020/6/5	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.057				-	▲ 0.094	0.040	0.015	22,863.73	167.99	109.14-15	109.37-38
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.091						
2W							-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.101	▲ 0.123						
6M							▲ 0.198	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188						
									日付	5/29	6/1	6/2	6/3	6/4
									日銀当預残	4,271,400	4,204,400	4,182,800	4,164,600	4,171,100
									準備預金残	3,681,900	3,634,400	3,609,900	3,595,700	3,590,900
									マネタリーベース	5,434,300	5,367,400	5,346,700	5,328,500	5,335,400
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.058%	▲0.059%	▲0.068%	▲0.064%
									コール市場残高	137,926	150,042	149,841	146,084	157,110
									うち無担	120,286	129,682	130,723	127,334	136,031
									うちO/N	75,002	82,478	80,959	78,270	84,067
									うち有担	17,640	20,360	19,118	18,750	21,079

●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)
国庫短期証券	912	-	91,400	2020/6/8	2020/9/7	220,868.0	74,283.2	100.0230	▲0.0922%	4.0653%	100.0246	▲0.0986%	17,116.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/6/8			13,308	3,403	0.008		0.009	40.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2020/6/8			8,963	3,203	0.009		0.009	90.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2020/6/8			7,133	4,011	0.006		0.008	20.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/5	2020/6/8	▲ 0.350	272	272		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/5	2020/6/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/9	2020/6/16	0.320	0	0				

●2020年6月8日の予定

*1-3月期のGDP2次速報(市場予想：前期比年率▲2.1%)	*4月の特定サービス産業動態統計速報
*4月の国際収支	*5月の景気ウォッチャー調査

◆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