

Central Daily Market Report

2020年6月9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9日 需給速報	2020年6月10日 需給予想	2020年6月11日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 100	0
財政	9,400	▲ 7,600	0
資金過不足	9,100	▲ 7,700	0
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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			
CP等買入	6,000	▲ 500	▲ 700
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			15,600
E T F 買入			1,000
国債補完供給	▲ 500	400	500
米ドル資金供給用担保準備供給			▲ 7,300
当増減	14,500	1,400	0
当座預金残高	4,154,700	4,156,100	4,156,100
準備預金残高	3,584,900		
積み終了先	3,584,600		
超過準備	3,584,600		
非準備預金先	569,800		
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	99.96%	日数
			80.65%

●2020年6月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、大手行を中心に積極的に取り上がる動きが見られたため、前日より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▲0.05~▲0.045%、地銀・外銀業態などから▲0.06~▲0.04%での調達となった。一巡後は▲0.075~▲0.05%近辺で散発的な出会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(6/10-6/11)は、▲0.065~▲0.05%程度での出会い。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2Y402~413、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TB6M物(913回)の入札が実施された。WI取引において▲0.160%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1753%、按分落札利回▲0.1733%と、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.200%出会いと堅調な推移となった。その他に、3M物が▲0.108%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、陸運業態から1,000億円程度の調達が見られ、発行総額は1,800億円程度と償還総額600億円程度を上回った。大型案件においても、足切りは流れず浅いマイナスで決着するなど、レートは低位での推移が続いている。

●短期金融市場関連指標

2020/6/9	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.048				-	▲ 0.064	0.015	▲ 0.025	23,091.03	▲ 87.07	108.40-42	107.92-93
T/N							-	▲ 0.062						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.033				-	▲ 0.072						
2W							-	▲ 0.082						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.108	▲ 0.120						
6M							▲ 0.200	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.205	▲ 0.187						
									日付	6/2	6/3	6/4	6/5	6/8
									日銀当預残	4,182,800	4,164,600	4,171,100	4,169,900	4,140,200
									準備預金残	3,609,900	3,595,700	3,590,900	3,583,700	3,569,500
									マネタリーベース	5,346,700	5,328,500	5,335,400	5,334,200	5,304,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.068%	▲ 0.064%	▲ 0.057%	▲ 0.055%
									コール市場残高	149,841	146,084	157,110	153,789	142,483
									うち無担	130,723	127,334	136,031	135,147	124,046
									うちO/N	80,959	78,270	84,067	84,513	74,032
									うち有担	19,118	18,750	21,079	18,642	18,437

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償額競争入札(億円)
国庫短期証券	913	-	28,000	2020/6/10	2020/12/10	112,947.0	22,716.7	100.0870	▲0.1733%	35.0757%	100.0880	▲0.1753%	5,283.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/6/9	2020/6/10	▲ 0.350	461	461		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/9	2020/6/10	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/11	2020/6/18	0.330	7,933	7,933				
米ドル資金供給		2020/6/11	2020/9/3	0.330	15,890	15,890				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	3000	2020/6/15			3,757	3,003	▲ 0.140		▲ 0.114	12.3
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	10000	2020/6/10	2020/6/19		6,189	6,189		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5000	2020/6/10	2020/9/4		1,027	1,027		▲ 0.100	▲ 0.100	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2020/6/10	2020/12/25	0	15,631

●2020年6月10日の予定

*4月の機械受注統計 (市場予想:電力除く民需、前月比▲8.6%)	*米国FOMC(2日目)	*米国FRB経済見通し発表	*交付税特別会計借入 (21,000億円、6/19借入)
*5月の企業物価指数	*米国5月の財政収支	*米国5月の消費者物価指数	

◆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