

Central Daily Market Report

2020年6月10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10日		2020年6月11日		2020年6月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 1,100			0
財政	▲ 6,300		1,800		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 6,400		700		▲ 8,000	
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			8,200			
CP等買入		▲ 700		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					500	▲ 900
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		1,000			
国債補完供給	▲ 600	500		600		
※ドル資金供給用担保提供	▲ 7,300					9,300
当増減	2,100		9,900		900	
当座預金残高	4,156,800		4,166,700		4,167,600	
準備預金残高	3,581,000					
積み終了先	3,580,800		6月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,580,800		積数		1,000	
非準備預金先	575,800		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	99.97%	日数	83.87%		

●2020年6月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き大手行を中心に資金調達ニーズが強く、昨日よりもさらに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▲0.04%近辺、地銀・外銀業態などから▲0.04~▲0.03%での調達となった。一巡後は▲0.075~▲0.04%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(6/11-6/12)は、▲0.055~▲0.04%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2Y402~413、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>

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

発行市場は小型の案件が多く、発行総額は250億円程度と、償還総額の2,000億円程度を下回った。発行レートについては、横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2020/6/10	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.038					-	▲ 0.059	0.020	0.005	23,124.95	33.92	107.79-80	107.33-35
T/N			▲ 0.001					-	▲ 0.055						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.036					-	▲ 0.069						
2W			▲ 0.010					-	▲ 0.078						
3W								-	▲ 0.092						
1M								-	▲ 0.109						
3M								▲ 0.108	▲ 0.123						
6M								▲ 0.198	▲ 0.163						
1Y								▲ 0.205	▲ 0.187						
										日付	6/3	6/4	6/5	6/8	6/9
										日銀当預残	4,164,600	4,171,100	4,169,900	4,140,200	4,154,700
										準備預金残	3,595,700	3,590,900	3,583,700	3,569,500	3,580,200
										マネタリーベース	5,328,500	5,335,400	5,334,200	5,304,100	5,318,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.064%	▲ 0.057%	▲ 0.055%	▲ 0.048%
										コール市場残高	146,084	157,110	153,789	142,483	140,077
										うち無担	127,334	136,031	135,147	124,046	121,033
										うちO/N	78,270	84,067	84,513	74,032	71,014
										うち有担	18,750	21,079	18,642	18,437	19,044

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	21,000	2020/6/19	2020/12/18	482,577.0	21,000.05		0.0000%	4.3517%		0.0000%	

●オペ結果

種類	オフター額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	申込総額(億円・百万ドル)	預札総額(億円・百万ドル)	貸付率	全取レート・利回差	平均預札レート・利回差	貸付率
国債買入(残存期間1年以下)	800	2020/6/11			1,537	801		0.004	0.005	67.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,200	2020/6/11			10,406	3,205		0.003	0.004	43.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2020/6/11			9,739	4,008		▲ 0.001	0.001	17.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2020/6/10	2020/6/11	▲ 0.350	568	568		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2020/6/10	2020/6/11	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/12	2020/6/19	0.330	0	0				
種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)					
被災地金融支援オペ	第110回	2020/6/12	2021/6/11	0	494					
被災地金融支援オペ(熊本)	第49回	2020/6/12	2021/6/11	0	42					

●2020年6月11日の予定

*4-6月期の法人企業景気予測調査季報	*米5月生産者物価指数	*流動性供給入札(5,000億円、6/12発行)
---------------------	-------------	--------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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