

Central Daily Market Report

2020年6月8日(月)

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8日		2020年6月9日		2020年6月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 200		0	
財政	▲ 40,600		9,000		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 40,300		8,800		▲ 3,000	
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		▲ 200	6,000	▲ 500		
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 400	300		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 29,700		14,700		▲ 3,000	
当座預金残高	4,140,200		4,154,900		4,151,900	
準備預金残高	3,569,500					
積み終了先	3,569,300					
超過準備	3,569,300					
非準備預金先	570,700					
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	77.42%		

●2020年6月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落したものの参加者の調達意欲は然程変わらず、前営業日とほぼ同水準での取引となった。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▲0.065~▲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(6/9-6/10)は、▲0.09~▲0.06%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等にビッグの出入りがあった。

<短国市場>

アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.1075%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、スポット五・十日にあたるものの発行案件は膨らまず、発行総額は700億円程度と償還総額1,700億円程度を下回った。発行レートは特段の変化はなく、横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2020/6/8	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	
	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)	為替(17時)
単位:%							売買参考統計値	平均値	0.040	0.000	23,178.10	314.37	109.61-63	109.48-50
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.084						
T/N							-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.035	▲ 0.049				-	▲ 0.088						
2W			0.300				-	▲ 0.093						
3W			▲ 0.065				-	▲ 0.100						
1M							-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.108	▲ 0.123						
6M							▲ 0.198	▲ 0.164						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.188						
									日付	6/1	6/2	6/3	6/4	6/5
									日銀当預残	4,204,400	4,182,800	4,164,600	4,171,100	4,169,900
									準備預金残	3,634,400	3,609,900	3,595,700	3,590,900	3,583,700
									マネタリーベース	5,367,400	5,346,700	5,328,500	5,335,400	5,334,200
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.059%	▲0.068%	▲0.064%	▲0.057%
									コール市場残高	150,042	149,841	146,084	157,110	153,789
									うち無担	129,682	130,723	127,334	136,031	135,147
									うちO/N	82,478	80,959	78,270	84,067	84,513
									うち有担	20,360	19,118	18,750	21,079	18,642

●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)	募入最低値	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)		2020/6/8	2020/6/9	▲ 0.350	382	382		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/6/8	2020/6/9	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/6/10	2020/6/17	0.320	172	172				

●2020年6月9日の予定

*4月の毎月勤労統計調査速報	*米国FOMC(1日目)	*国庫短期証券(913回)入札
*5月のマネーストック	*米国4月の卸売売上高	(6ヶ月、28,000億円、6/10発行)
	*ユーロ圏1-3月期GDP確報値	

◆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