

# 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         |           |
| <b>金融調節</b>           | 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 | 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) | 残額総額(億円・百万ドル) | 貸付率 | 全取レート・利回差 | 平均貸付レート・利回差 | 貸付比率 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|---------|---------------|---------------|-----|-----------|-------------|------|
| 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