

# Central Daily Market Report

2020年3月24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3月24日 需給速報	2020年3月25日 需給予想	2020年3月26日 当社予想
銀行券	100	▲ 500	0
財政	▲ 2,300	15,900	11,000
資金過不足	▲ 2,200	15,400	11,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出	100		▲ 100
全店共通			
国債買現			
国債売現	▲ 8,000	▲ 8,000	
国庫短期証買入	2,500		
国債買入	9,800		
CP等買入	5,000	▲ 100	▲ 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			
新型コロナ企業金融支援特別			34,000
E T F 買入	200		900
国債補完供給	▲ 22,700	18,700	22,700
米ドル資金供給用担保国債供給	▲ 43,100	▲ 98,200	
当預増減	▲ 39,800	▲ 34,000	11,000
当座預金残高	3,983,600	3,949,600	3,960,600
準備預金残高	3,469,000		
積み終了先	3,466,900		
超過準備	3,465,600		
非準備預金先	514,600		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,247,700
準備預金進捗率	実績	99.53%	日数
			29.03%

## ●2020年3月24日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀・証券業態を中心に▲0.07~▲0.01%とワイドレンジの出会いとなった。ビッドサイドの調達ニーズは引き続き強く、レートは前日比で上昇した。ターム物は引き続きオファーが薄く、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(3/25-3/26)は、▲1.00~▲0.30%程度での出会い。昨日3年ぶりにオファーされた売現先オペは、本日も実施された。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2Y402~410、5Y136~142、10Y335~357、20Y167~171、30Y59~65、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.480~▲0.444%、6M物が▲0.347%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、発行・償還ともに3,000億円程度の規模となり、鉄鋼等の業態が大型発行を実施した。発行レートについては、引き続きレートを切り上げて調達する動きが見られている。

## ●短期金融市場関連指標

2020/3/24	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	▲ 0.039				-	▲ 0.833	0.035	▲ 0.030	18,092.35	1,204.57	110.79-83	110.52-55
T/N	▲ 0.040	0.000	▲ 0.032				-	▲ 0.880						
S/N								-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.450						
2W							-	▲ 0.378						
3W							-	▲ 0.340						
1M							-	▲ 0.320						
3M							▲ 0.440	▲ 0.301						
6M							▲ 0.343	▲ 0.279						
1Y							▲ 0.293	▲ 0.273						
									日付	3/16	3/17	3/18	3/19	3/23
									日銀当預残	3,908,400	3,899,300	3,910,200	3,936,200	4,023,400
									準備預金残	3,413,300	3,413,100	3,415,900	3,437,200	3,518,200
									マネタリーベース	5,048,800	5,040,000	5,051,600	5,078,800	5,165,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.068%	▲ 0.063%	▲ 0.051%	▲ 0.048%
									コール市場残高	118,326	115,143	117,221	128,301	130,142
									うち無担	98,338	102,748	106,619	117,668	121,986
									うちO/N	67,495	71,975	73,811	76,770	81,458
									うち有担	19,988	12,395	10,602	10,633	8,156

## ●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)
流動性供給	306	-	4,000	2020/3/25		17,286.0	3,993.0		▲0.0210%	8.9795%		▲0.0290%	

## ●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)		2020/3/24	2020/3/25	▲ 0.850	20,739	20,739		▲ 0.850	▲ 0.850	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/24	2020/3/25	▲ 0.850	1,472	1,472		▲ 0.850	▲ 0.850	
米ドル資金供給		2020/3/26	2020/4/2	0.360	15,465	15,465				
米ドル資金供給		2020/3/26	2020/6/18	0.350	73,805	73,805				
国債売現先	8000	2020/3/25	2020/3/31		33,250	8,000	▲ 0.270		▲ 0.371	50.0
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	20,000	2020/3/25	2020/4/3		18,398	18,398		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	85,000	2020/3/25	2020/6/19		78,283	78,283		▲ 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)					
新型コロナ企業金融支援特別オペ		第1回	2020/3/25	2020/6/25	0	33,968				

## ●2020年3月25日の予定

\*金融政策決定会合における主な意見(3月16日分)

\*米国2月の耐久財新規受注

\*英国2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