Central Daily Market Report

2020年3月26日（木）
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26日 需給速報		2020年3月27日 需給予想		2020年3月30日 当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 700		0	
財政	15,700		▲ 3,500		30,000	
資金過不足	14,100		▲ 4,200		30,000	
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						▲ 8,800
国債買現						
国債売現	▲ 4,000		▲ 8,000			
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 600		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入			2,000			
新型コロナ企業金融支援特別						
ＥＴＦ買入	600		1,000			
国債補完供給	▲ 3,400	5,900		3,400		
＊ドル資金供給用担保国債供給	▲ 2,700		▲ 1,400	2,500		
当預増減	9,900		▲ 5,300		21,200	

当座預金残高	3,953,600	3,948,300	3,969,500
準備預金残高	3,436,600		
積み終了先	3,435,400		
超過準備	3,435,400		
非準備預金先	517,000		

3月27日以降の残り所要積立額	
積数	12,600
1日平均	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	99.61%	日数 35.48%

●2020年3月26日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態を中心に▲0.05～▲0.001%の出合いとなった。引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く▲0.01%近辺での出合いが中心となった。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(3/27-3/30)は、▲0.23～▲0.15%程度での出合い。本日の国債売現先オペは、期末越え1W物でのオファーとなった。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、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、商社等から大型発行案件が見られたものの、償還総額5,700億円弱に対して、発行総額は3,000億円程度にとどまり、引き続き償還超となった。発行レートは銘柄間の較差は大きいものの、引き続き総じて上昇傾向が見られている。また、今年度最後となるCP等買入オペが、事前予定額から500億円増額の5,500億円でオファーされた。オファー額が増加したものの、直近の市場残高の急速な拡大を受け、按分落札レート0.003%、平均落札レート0.008%と前回比でいずれも大幅に上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/3/26	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.020				－	▲ 0.191
T/N	▲ 0.005	0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.200
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.270
2W							－	▲ 0.233
3W							－	▲ 0.226
1M							－	▲ 0.235
3M							▲ 0.330	▲ 0.242
6M							▲ 0.325	▲ 0.263
1Y							▲ 0.280	▲ 0.267

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.002	▲ 0.028	18,664.60	▲ 882.03	110.84-86	110.47-49

日付	3/18	3/19	3/23	3/24	3/25
日銀当預残	3,910,200	3,936,200	4,023,400	3,983,600	3,943,700
準備預金残	3,415,900	3,437,200	3,518,200	3,469,500	3,434,000
マネタリーベース	5,051,600	5,078,800	5,165,400	5,125,500	5,086,100
無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.051%	▲0.048%	▲0.039%	▲0.028%
コール市場残高	117,221	128,301	130,142	124,350	127,148
うち無担	106,619	117,668	121,986	116,487	118,396
うちO/N	73,811	76,770	81,458	80,484	83,393
うち有担	10,602	10,633	8,156	7,863	8,752

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
40年利付国債	12	0.50%	4,000	2020/3/27	2059/3/20	10,621.0	3,996.0		0.4500%	30.5135%			

●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
CP等買入	5,500	2020/3/31			14,830	5,495	0.003		0.008	70.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/3/26	2020/3/27	▲ 0.45	3,144	3,144		▲0.450	▲0.652	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/3/26	2020/3/27	▲ 0.45	109	109		▲0.450	▲0.450	
米ドル資金供給		2020/3/30	2020/4/6	0.32	2,265	2,265				
国債売現先	8,000	2020/3/27	2020/4/3		30,500	8,000	▲0.210		▲0.234	12.5
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2020/3/27	2020/4/7		1,396	1,396		▲0.100	▲0.100	

●2020年3月27日の予定

＊3月の都区部消費者物価指数（CPI）
＊米国2月の個人所得・消費支出
＊国庫短期証券（897回）入札
（3ヶ月、47,400億円、3/30発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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