

Central Daily Market Report

2020年3月30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3月30日 需給速報	2020年3月31日 需給予想	2020年4月1日 当社予想			
銀行券	▲ 600	▲ 100	1,000			
財政	38,800	10,700	▲ 28,000			
資金過不足	38,200	10,600	▲ 27,000			
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	10,800	▲ 8,800				
国債買現						
国債売現	▲ 8,000	▲ 20,100	16,000		20,000	
国庫短期証買入						
国債買入	11,500					
CP等買入		▲ 700	5,500	▲ 4,200		
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						
E T F 買入	300		200			
国債補完供給	▲ 1,900	1,600		1,900		
※ドル資金供給用担保国債供給	▲ 15,800		▲ 21,800			
当預増減	27,200		▲ 11,900			▲ 7,000
当座預金残高	3,972,900		3,961,000			3,954,000
準備預金残高	3,435,900					
積み終了先	3,435,300				3月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,435,300				積数	5,800
非準備預金先	537,000				1日平均	400
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	99.82%		日数		48.39%

●2020年3月30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▲0.03～▲0.001%の出会いとなった。引き続きビッドサイドの調達ニーズが強く、レートは前日比で横ばいでの推移となった。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(3/31-4/1)は、▲1.00～▲0.30%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2Y402～410、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、大幅低下。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.210～▲0.200%で出合った。

＜CP市場＞

現先レートは、概ね横ばい圏で推移した。CP発行市場は、償還額が200億円であるのに対して、発行日の中心が新年度入りしたことで発行総額が4,000億円となった。発行レートは、高止まりや札割れも散見され、発行体によりばらつきがみられた。

●短期金融市場関連指標

2020/3/30	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	▲ 0.017				-	▲ 0.168	0.000	▲ 0.005	19,084.97	▲ 304.46	107.45-47	107.98-00
T/N	▲ 0.150	▲ 0.050	▲ 0.120				-	▲ 0.575						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	0.002	▲ 0.001				-	▲ 0.262						
2W							-	▲ 0.215						
3W							-	▲ 0.191						
1M			0.000				-	▲ 0.190						
3M							▲ 0.210	▲ 0.196						
6M							▲ 0.230	▲ 0.237						
1Y							▲ 0.220	▲ 0.246						
									日付	3/23	3/24	3/25	3/26	3/27
									日銀当預残	4,023,400	3,983,600	3,943,700	3,953,600	3,945,700
									準備預金残	3,518,200	3,469,500	3,434,000	3,436,800	3,418,400
									マネタリーベース	5,165,400	5,125,500	5,086,100	5,097,600	5,090,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.039%	▲ 0.028%	▲ 0.020%	▲ 0.017%
									コール市場残高	130,142	124,350	127,148	129,184	127,519
									うち無担	121,986	116,487	118,396	121,727	116,856
									うちO/N	81,458	80,484	83,393	85,824	82,973
									うち有担	8,156	7,863	8,752	7,457	10,663

●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	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)		2020/3/30	2020/3/31	▲ 0.450	1,816	1,816		▲ 0.450	▲ 0.453	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/30	2020/3/31	▲ 0.450	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/1	2020/4/8	0.320	24,100	24,100				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	30,000	2020/3/31	2020/4/9		21,280	21,280		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年3月31日の予定

*2月の完全失業率(市場予想:2.4%)	*米国1月S&P/ケースシラー住宅価格指数	*2年利付国債入札(20,000億円、4/1発行)
*2月の有効求人倍率(市場予想:1.47倍)	*米国3月のシカゴPM景況感指数	
*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.1%)	*米国3月の米CB消費者信頼感指数	
*2月の商業動態統計速報	*英国10-12月期のGDP確報値	
*2月の住宅着工統計	*ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値	

◆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