

Central Daily Market Report

2020年4月1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4月1日 需給速報		2020年4月2日 需給予想		2020年4月3日 当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 1,000			0
財政	▲ 24,900		▲ 14,200			▲ 16,000
資金過不足	▲ 25,200		▲ 15,200			▲ 16,000
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		20,100		8,000		12,000
国庫短期証買入	2,500					
国債買入			3,400			
CP等買入						
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	200		100			
国債補完供給	▲ 1,200	8,600		1,200		
米ドル資金供給用担保国債供給	▲ 40,600		▲ 400	43,100		18,400
当預増減	▲ 35,600		40,200			14,400
当座預金残高	3,917,000		3,957,200			3,971,600
準備預金残高	3,399,800					
積み終了先	3,399,400		4月2日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,398,600		積数	2,300		
非準備預金先	517,200		1日平均	200		
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	99.93%	日数	54.84%		

●2020年4月1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~▲0.005%での調達で始まった。年度末要因が剥落したことで出合いレートは大幅に上昇し、市場残高も増加した。一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.01%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/2-4/3)は、▲0.16~▲0.10%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2Y402~410、5Y136~142、10Y335~357、20Y167~171、30Y59~65、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▲0.200%で出合った。

<CP市場>

CP市場は、償還が約1,000億円に対し、発行は予備的なものを含めて調達意欲が強く、総額6,000億円弱となった。発行レートは銘柄によりまちまちであった。

●短期金融市場関連指標

2020/4/1	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.022				-	▲ 0.116	0.001	▲ 0.009	18,065.41	▲ 851.60	107.50-53	107.64-67
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.142						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	0.002	▲ 0.005				-	▲ 0.149						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.004				-	▲ 0.153						
3W	0.000	0.005	0.003				-	▲ 0.167						
1M	0.000	0.180	0.004				-	▲ 0.188						
3M			0.005				▲ 0.200	▲ 0.199						
6M							▲ 0.170	▲ 0.225						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.238						
									日付	3/25	3/26	3/27	3/30	3/31
									日銀当預残	3,943,700	3,953,600	3,945,700	3,972,900	3,952,600
									準備預金残	3,434,000	3,436,800	3,418,400	3,435,900	3,443,700
									マネタリーベース	5,086,100	5,097,600	5,090,600	5,118,400	5,098,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.020%	▲ 0.017%	▲ 0.017%	▲ 0.070%
									コール市場残高	127,148	129,184	127,519	121,840	90,986
									うち無担	118,396	121,727	116,856	114,136	84,301
									うちO/N	83,393	85,824	82,973	80,583	63,203
									うち有担	8,752	7,457	10,663	7,704	6,685

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,800	2020/4/2			11,075	2,802	▲0.020		▲0.016	65.3
国債買入(物価連動債)	300	2020/4/2			1,325	303	▲0.060		▲0.113	28.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/1	2020/4/2	▲ 0.35	1,145	1,145		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/1	2020/4/2	▲ 0.35	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/3	2020/4/10	0.320	950	950				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/4/2	2020/4/13		367	367		▲0.100	▲0.100	

●2020年4月2日の予定

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*米国2月の貿易収支	*10年利付国債入札(21,000億円、4/3発行)
*3月のマネタリーベース	*米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫	*交付税特別会計借入(11,000億円、4/10借入)

◆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