

Central Daily Market Report

2020年4月3日(金)

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3日 需給速報	2020年4月6日 需給予想	2020年4月7日 当社予想
銀行券	▲ 300	1,000	2,000
財政	▲ 23,300	▲ 10,900	4,000
資金過不足	▲ 23,600	▲ 9,900	6,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,000	
国債買現			
国債売現	12,000		
国庫短期証買入			
国債買入		7,800	
CP等買入	▲ 100		
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	
国債補完供給	▲ 3,400	1,400	3,400
※ドル資金供給用担保国債供給	▲ 400	18,600	▲ 6,300
		2,700	1,400
当預増減	4,500	▲ 100	7,400
当座預金残高	3,960,700	3,960,600	3,968,000
準備預金残高	3,445,300		
積み終了先	3,445,100		4月6日以降の残り所要積立額
超過準備	3,445,100		積数 1,500
非準備預金先	515,400		1日平均 100
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 99.95%	日数 67.74%	

●2020年4月3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▲0.025~▲0.005%での調達で始まった。引き続き調達意欲は強く、一巡後も朝方と横ばい圏のレートでの出会いが見られた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.01%近辺の出会いが見られた。共通担保資金供給オペは15,000億円(4/6~4/13)オファーされ、応札額2,000億円と札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(4/6-4/7)は、▲0.15~▲0.10%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2Y402~411、5Y136~142、10Y335~358、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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.145~▲0.132%で出合中、平均落札利回▲0.1218%、按分落札利回▲0.1022%と、テールが流れる弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.150~▲0.140%出会いと堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、まとまった金額の発行が数件あったこともあり、総額4,000億円弱となった。発行レートは、引き続き銘柄によりばらつきがあり、方向感を探る展開となった。

●短期金融市場関連指標

2020/4/3	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				-	▲ 0.099	▲ 0.014	▲ 0.009	17,820.19	1.47	108.01-04	108.21-24
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.142						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.135						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.138						
3W	0.001	0.003	0.002				-	▲ 0.146						
1M			0.080				-	▲ 0.160						
3M							▲ 0.145	▲ 0.163						
6M							▲ 0.170	▲ 0.211						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.226						
									日付	3/27	3/30	3/31	4/1	4/2
									日銀当預残	3,945,700	3,972,900	3,952,600	3,917,000	3,956,200
									準備預金残	3,418,400	3,435,900	3,443,700	3,399,800	3,440,400
									マネタリーベース	5,090,600	5,118,400	5,098,100	5,062,800	5,103,200
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.017%	▲0.070%	▲0.022%	▲0.020%
									コーポ市場残高	127,519	121,840	90,986	119,308	117,869
									うち無担	116,856	114,136	84,301	103,368	108,291
									うちO/N	82,973	80,583	63,203	79,685	80,603
									うち有担	10,663	7,704	6,685	15,940	9,578

●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)
国庫短期証券	898	-	50,400	2020/4/6	2020/7/6	156,866.0	40,895.6	100.0255	▲0.1022%	12.2729%	100.0304	▲0.1218%	9,504.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2020/4/6	2020/4/13		2,000	2,000				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,200	2020/4/6			6,838	3,201	0.007		0.010	38.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,800	2020/4/6			8,251	2,803	0.012		0.014	29.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/4/6			3,342	1,203	0.001		0.002	98.3
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/4/6			971	300		▲0.002	▲0.002	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/3	2020/4/6	▲ 0.350	1,960	1,960		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/3	2020/4/6	▲ 0.350	1,365	1,365		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/4/7	2020/4/14	0.320	5,750	5,750				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	10,000	2020/4/6	2020/4/15		6,132	6,132		▲0.100	▲0.100	

●2020年4月6日の予定

特にありません。

◆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