

Central Daily Market Report

2020年4月6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4月6日 需給速報	2020年4月7日 需給予想	2020年4月8日 当社予想
銀行券	800	▲ 400	1,000
財政	▲ 6,800	8,800	▲ 5,000
資金過不足	▲ 6,000	8,400	▲ 4,000
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			
国庫短期証買入			
国債買入	7,800	5,800	
CP等買入		▲ 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		▲ 200	
新型コロナウイルス金融支援特別			
E T F買入	200	700	
国債補完供給	▲ 1,900	3,400	1,900
※ドル資金供給用担保国債供給	▲ 6,300	2,700	▲ 15,200
▲ 1,400			15,400
当預増減	1,900	2,600	11,400
当座預金残高	3,962,600	3,965,200	3,976,600
準備預金残高	3,441,900		
積み終了先	3,441,700		
超過準備	3,441,700		
非準備預金先	520,700		
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	99.96%	日数
			70.97%

●2020年4月6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~▲0.01%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、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%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(4/7-4/8)は、▲0.30~▲0.13%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2Y402~411、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、同意なく閑散な中、3M物が▲0.150%で出合った。

<CP市場>

発行市場は償還総額50億円程度に対して、発行総額は1,700億円程度と発行超であった。複数業態において案件が見られ活況なマーケットとなった。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

2020/4/6	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				-	▲ 0.122	0.000	0.014	18,576.30	756.11	108.70-73	109.17-19
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.160						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.008				-	▲ 0.150						
2W							-	▲ 0.152						
3W							-	▲ 0.156						
1M			0.003				-	▲ 0.169						
3M							▲ 0.150	▲ 0.156						
6M							▲ 0.170	▲ 0.214						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.225						
									日付	3/30	3/31	4/1	4/2	4/3
									日銀当預残	3,972,900	3,952,600	3,917,000	3,956,200	3,960,700
									準備預金残	3,435,900	3,443,700	3,399,800	3,440,400	3,445,300
									マネタリーベース	5,118,400	5,098,100	5,062,800	5,103,200	5,108,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.070%	▲ 0.022%	▲ 0.020%	▲ 0.017%
									コール市場残高	121,840	90,986	119,308	117,869	123,580
									うち無担	114,136	84,301	103,368	108,291	107,986
									うちO/N	80,583	63,203	79,685	80,603	77,398
									うち有担	7,704	6,685	15,940	9,578	15,594

●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1年以下)	800	2020/4/7			2,367	801	0.001		0.007	8.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/4/7			10,605	3,504	0.015		0.019	82.5
国債買入(変動利付債)	1000	2020/4/7			3,520	1,003	▲ 0.280		▲ 0.286	97.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/6	2020/4/7	▲ 0.350	1,874	1,874		▲ 0.350	▲ 0.352	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/6	2020/4/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/8	2020/4/15	0.310	12,880	12,880				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	15,000	2020/4/7	2020/4/16		14,798	14,798		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年4月7日の予定

*2月の毎月勤労統計調査速報	*米国2月の消費者信用残高	*30年利付国債入札(7,000億円、4/8発行)
*2月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲3.9%)		
*2月の景気動向指数速報		
*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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