

# Central Daily Market Report

2020年4月7日(火)

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7日 需給速報	2020年4月8日 需給予想	2020年4月9日 当社予想
銀行券	▲ 500	100	0
財政	12,300	▲ 5,400	2,000
資金過不足	11,800	▲ 5,300	2,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		2,500	
国債買入	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	
新型コロナ企業金融支援特別			
E T F買入	700	300	
国債補充供給	▲ 2,300	1,900	2,300
米ドル資金供給用担保国債供給	▲ 15,200	1,400	▲ 34,700
当預増減	3,700	▲ 19,100	23,300
当座預金残高	3,966,300	3,947,200	3,970,500
準備預金残高	3,426,500		
積み終了先	3,426,300		4月8日以降の残り所要積立額
超過準備	3,426,300		積数 1,100
非準備預金先	539,800		1日平均 100
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,255,300
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数 74.19%

## ●2020年4月7日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.04~▲0.015%近辺での調達で始まった。昨日に比べ調達レートを引き下げる動きが見られ、一巡後は▲0.06~▲0.02%近辺で散発的な出会いが見られ本日の取引を終えた。ターム物は、オファーサイドが少なく閑散なマーケットとなった。

### <レポ市場>

GC T/N(4/8-4/9)は、▲0.30~▲0.20%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、短国買入オペが前回と同額の2,500億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差▲0.004%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.155%で出合った。

### <CP市場>

発行市場は償還総額400億円程度に対して、発行総額は2,100億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

2020/4/7	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	▲ 0.035				-	▲ 0.146	0.001	0.001	18,950.18	373.88	109.12-14	108.87-88
T/N	▲ 0.080	▲ 0.010	▲ 0.057				-	▲ 0.253						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.201						
2W							-	▲ 0.197						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.190						
1M							-	▲ 0.200						
3M							▲ 0.150	▲ 0.165						
6M							▲ 0.170	▲ 0.214						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.225						
									日付	3/31	4/1	4/2	4/3	4/6
									日銀当預残	3,952,600	3,917,000	3,956,200	3,960,700	3,962,600
									準備預金残	3,443,700	3,399,800	3,440,400	3,445,300	3,441,900
									マネタリーベース	5,098,100	5,062,800	5,103,200	5,108,000	5,109,100
									無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.022%	▲0.020%	▲0.017%	▲0.022%
									コール市場残高	90,986	119,308	117,869	123,580	108,317
									うち無担	84,301	103,368	108,291	107,986	101,150
									うちO/N	63,203	79,685	80,603	77,398	70,007
									うち有担	6,685	15,940	9,578	15,594	7,167

## ●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)
30年利付国債	66	0.40%	7,000	2020/4/8	2050/3/20	20,180.0	5,722.0	98.9000	0.4410%	28.6764%	99.2900	0.4260%	1,275.0

## ●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
国庫短期証券買入	2,500	2020/4/8			6,611	2,501	▲0.004		0.003	80.4
社債等買入	1,500	2020/4/13			2,833	1,500	0.082		0.117	94.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/7	2020/4/8	▲ 0.350	2,303	2,303		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/7	2020/4/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/9	2020/4/16	0.300	9,360	9,360				
米ドル資金供給		2020/4/9	2020/7/2	0.330	29,442	29,442				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	15,000	2020/4/8	2020/4/17		10,812	10,812		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	25,000	2020/4/8	2020/7/3		23,118	23,118		▲ 0.100	▲ 0.100	

## ●2020年4月8日の予定

*2月の機械受注統計(市場予想：電力除く民需、前月比▲2.7%)	*交付税特別会計借入(11,000億円、4/17借入)
*2月の国際収支	
*2月の特定サービス産業動態統計速報	
*3月の景気ウォッチャー調査	

◆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