

Central Daily Market Report

2020年4月14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14日		2020年4月15日		2020年4月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 500		▲ 1,000	
財政	▲ 1,500		82,400		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 2,000		81,900		▲ 2,000	
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						
国庫短期証券買入			2,500			
国債買入	9,800					
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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	800		900			
国債補充供給	▲ 600	1,100		600		
※ドル資金供給用担保債供給		400	▲ 20,000	6,300		14,800
当預増減	9,300		71,900		12,800	
当座預金残高	3,980,600		4,052,500		4,065,300	
準備預金残高	3,452,800					
積み終了先	3,452,600		4月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,452,600		積数		200	
非準備預金先	527,800		1日平均		200	
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	99.99%	日数	96.77%		

●2020年4月14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▲0.01~▲0.005%での調達で始まった。積み最終日を前に引き続き調達意欲は強く、一巡後も▲0.01%近辺での出合いが数件見られた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(4/15-4/16)は、▲0.09~▲0.05%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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日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+0.010%、按分落札利回較差+0.002%と、在庫調整の売りからか、やや弱めの結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,200億程度、発行総額は1,600億円程度であり、引き続き減額発行が散見された。発行レートは、引き続き銘柄間の格差が大きい結果となった。本日はCP等買入オペが、事前予定額から1,500億円増額の5,500億円でオファーされた。平均落札レート0.164%、按分レート0.106%と、直近の発行市場を反映し、前回比で大幅に上昇する結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/4/14	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.082	0.009	0.009	19,638.81	595.41	107.63-64	107.66-68
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.104						
2W	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.128						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.145	▲ 0.153						
6M							▲ 0.180	▲ 0.197						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.208						
									日付	4/7	4/8	4/9	4/10	4/13
									日銀当預残	3,966,300	3,943,100	3,971,800	3,969,200	3,971,300
									準備預金残	3,426,500	3,402,400	3,428,200	3,421,400	3,443,600
									マネタリーベース	5,113,400	5,090,100	5,120,100	5,117,700	5,119,600
									無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.046%	▲0.048%	▲0.032%	▲0.019%
									コール市場残高	114,438	108,685	110,069	124,359	117,152
									うち無担	103,852	101,522	102,607	105,994	99,367
									うちO/N	71,669	68,959	69,324	71,861	64,884
									うち有担	10,586	7,163	7,462	18,365	17,785

●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)
流動性供給	307	-	5,000	2020/4/15		11,948.0	4,991.0		0.0220%	56.8561%		0.0160%	

●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	2020/4/15			8,149	2,500	0.002		0.010	14.5
CP等買入	5,500	2020/4/17			17,240	5,500	0.106		0.164	47.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/14	2020/4/15	▲ 0.350	532	532		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/14	2020/4/15	▲ 0.350	33	33		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/4/16	2020/4/23	0.310	2,210	2,210				
米ドル資金供給		2020/4/16	2020/7/9	0.330	26,958	26,958				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/4/15	2020/4/24		917	917		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	20,000	2020/4/15	2020/7/10		18,681	18,681		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年4月15日の予定

*2月の石油等消費動態統計

*米国ページブック
*米国2月の企業在庫

*米国3月の小売売上高
*米国3月の鉱工業生産・設備稼働率

◆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