

Central Daily Market Report

2020年4月16日(木)
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16日		2020年4月17日		2020年4月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 1,100			0
財政	5,800		8,100			▲ 5,000
資金過不足	4,600		7,000			▲ 5,000
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						
国庫短期証買入						
国債買入	4,000					
CP等買入			5,500	▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			1,300	▲ 1,300		
社債等買入				▲ 300		
新型コロナ企業金融支援特別						
E T F買入			1,600			
国債補完供給	▲ 300			300		
※ドル資金供給用担保提供供給		15,200		11,100		
当預増減	23,500		25,000			▲ 5,000
当座預金残高	4,076,100		4,101,100			4,096,100
準備預金残高	3,536,200					
積み終了先	2,119,800				4月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	926,300				積数	599,500
非準備預金先	539,900				1日平均	20,700
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						3,209,400
準備預金進捗率	実績	81.32%	日数	3.33%		

●2020年4月16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▲0.070~▲0.015%の出会いが中心となった。新積み期入りし、昨日の過熱感も剥落したものの調達ニーズは底堅く、比較的広いレンジで出会いがみられた。ターム物に関しては、水準を見極める姿勢から目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(4/17-4/18)は、▲0.145~▲0.105%程度での出会い。SCはローラー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TB1Y物(901回)の入札が実施され、WI取引において▲0.150%での出会いが見られる中、平均落札利回▲0.1547%、按分落札利回▲0.1477%としっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.165~▲0.160%出会いと堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は1,400億円程度、発行総額は900億円程度で、引き続き減額発行が散見された。発行レートは、五・十日発行としては発行が少なかったこともあり、直近の水準よりも若干低下した。

●短期金融市場関連指標

2020/4/16	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.044				-	▲ 0.124	0.000	▲ 0.015	19,290.20	▲ 259.89	107.62-63	107.82-83
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.136						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.124						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.135						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.142						
3M							▲ 0.160	▲ 0.149						
6M							▲ 0.170	▲ 0.191						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.203						
									日付	4/9	4/10	4/13	4/14	4/15
									日銀当預残	3,971,800	3,969,200	3,971,300	3,980,600	4,052,600
									準備預金残	3,428,200	3,421,400	3,443,600	3,452,800	3,511,200
									マネタリーベース	5,120,100	5,117,700	5,119,600	5,129,300	5,202,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.048%	▲ 0.032%	▲ 0.019%	▲ 0.010%	▲ 0.009%
									コール市場残高	110,069	124,359	117,152	120,269	119,271
									うち無担	102,607	105,994	99,367	101,892	101,314
									うちO/N	69,324	71,861	64,884	65,709	65,086
									うち有担	7,462	18,365	17,785	18,377	17,957

●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	901	-	19,000	2020/4/20	2021/4/20	70,545.0	15,459.9	100.1480	▲0.1477%	61.7142%	100.1550	▲0.1547%	3,540.0
流動性供給	308	-	5,000	2020/4/17		18,701.0	4,992.0		▲0.0090%	42.9524%		▲0.0110%	
交付税特会	-	-	11,000	2020/4/24	2020/10/23	244,797.0	11,000.02		0.0000%	4.4936%		0.0000%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/16	2020/4/17	▲ 0.350	267	267		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/16	2020/4/17	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/20	2020/4/27	0.300	664	664				

●2020年4月17日の予定

*2月の第3次産業活動指数	*ユーロ圏3月の消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(902回)入札(3ヶ月、50,400億円、4/20発行)
*月例経済報告		

◆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