

Central Daily Market Report

2020年4月17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17日		2020年4月20日		2020年4月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,200		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	9,800		3,300		9,000	
資金過不足	8,600		1,900		8,000	
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			6,100			
CP等買入	5,500	▲ 200		▲ 300		
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		▲ 200		
新型コロナ企業金融支援特別						
E T F 買入	1,600		700			
国債補完供給		300				
※ドル資金供給用担保提供		11,100				
当預増減	26,600		8,200		8,000	
当座預金残高	4,102,600		4,110,800		4,118,800	
準備預金残高	3,564,000					
積み終了先	3,557,600		4月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,373,100		積数		27,000	
非準備預金先	538,600		1日平均		1,000	
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	99.16%	日数	13.33%		

●2020年4月17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▲0.087～▲0.020%の出合いが中心となった。週末を跨ぐ取引にあたるものの、水準を見極める動きから一部ビッドが後退し、昨日より出合い水準が低下した。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(4/20-4/21)は、▲0.12～▲0.09%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TB3M物(902回)の入札が実施され、WI取引において▲0.150%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1367%、按分落札利回▲0.1263%と弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.155～▲0.140%出合いと堅調に推移した。

＜CP市場＞

発行市場は償還総額100億円程度に対して、発行総額は600億円程度と発行超であった。案件数はあまり膨らまず、小型案件を中心とする落ち着いたマーケットであった。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

2020/4/17	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	▲ 0.046				-	▲ 0.109	0.010	0.010	19,897.26	607.06	107.93-95	107.79-81
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.119						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.127						
3W							-	▲ 0.133						
1M			▲ 0.018				-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.153	▲ 0.148						
6M							▲ 0.175	▲ 0.185						
1Y							▲ 0.174	▲ 0.201						
									日付	4/10	4/13	4/14	4/15	4/16
									日銀当預残	3,969,200	3,971,300	3,980,600	4,052,600	4,076,000
									準備預金残	3,421,400	3,443,600	3,452,800	3,511,200	3,536,100
									マネタリーベース	5,117,700	5,119,600	5,129,300	5,202,000	5,226,700
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.019%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.044%
									コール市場残高	124,359	117,152	120,269	119,271	118,346
									うち無担	105,994	99,367	101,892	101,314	103,332
									うちO/N	71,861	64,884	65,709	65,086	67,539
									うち有担	18,365	17,785	18,377	17,957	15,014

●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	902	-	50,400	2020/4/20	2020/7/20	134,460.0	40,895.5	100.0315	▲0.1263%	67.9682%	100.0341	▲0.1367%	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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,200	2020/4/20			8,860	3,204	0.012		0.013	94.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,800	2020/4/20			7,574	2,808	0.007		0.008	25.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/17	2020/4/20	▲ 0.350	14	14		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/17	2020/4/20	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/21	2020/4/28	0.300	640	640				

●2020年4月20日の予定

*3月の貿易統計

◆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