

Central Daily Market Report

2020年4月20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20日		2020年4月21日		2020年4月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 1,400		▲ 2,000	
財政	5,900		3,300		▲ 6,000	
資金過不足	4,400		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		▲ 300		▲ 100		
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					
国債補完供給	▲ 900			900		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	9,800		2,700		▲ 8,000	
当座預金残高	4,112,400		4,115,100		4,107,100	
準備預金残高	3,562,600					
積み終了先	3,557,800		4月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,556,900		積数		21,300	
非準備預金先	549,800		1日平均		900	
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	99.34%	日数	16.67%		

●2020年4月20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~▲0.015%の出会いが中心となった。一巡後は▲0.070~▲0.060%で調整の出会いが見られるのみだった。ターム物に関しては目立った出会いは見られなかった。

＜レポ市場＞

GCT/N(4/21-4/22)は、▲0.140~▲0.110%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、5Y136~143、10Y335~358、20Y167~171、30Y59~66、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

＜短国市場＞

本日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は案件3件のみと少なく、償還総額40億円程度に対し、発行総額350億円程度と閑散なマーケットとなった。発行案件が限られていることもあり、若干レートが低下する銘柄も見られたが、一方で目線が合わず発行を見送る銘柄も見られた。

●短期金融市場関連指標

2020/4/20	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	▲ 0.042				-	▲ 0.101	0.010	0.000	19,669.12	▲ 228.14	107.69-70	107.69-71
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.121						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.017				-	▲ 0.120						
2W							-	▲ 0.128						
3W							-	▲ 0.132						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.160	▲ 0.146						
6M							▲ 0.176	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.174	▲ 0.197						
									日付	4/13	4/14	4/15	4/16	4/17
									日銀当預残	3,971,300	3,980,600	4,052,600	4,076,000	4,102,600
									準備預金残	3,443,600	3,452,800	3,511,200	3,536,100	3,564,000
									マネタリーベース	5,119,600	5,129,300	5,202,000	5,226,700	5,254,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.044%	▲ 0.046%
									コール市場残高	117,152	120,269	119,271	118,346	118,134
									うち無担	99,367	101,892	101,314	103,332	104,283
									うちO/N	64,884	65,709	65,086	67,539	68,540
									うち有担	17,785	18,377	17,957	15,014	13,851

●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
社債等買入	1,500	2020/4/24			2,651	1,500	0.040		0.091	32.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/20	2020/4/21	▲ 0.350	906	906		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/20	2020/4/21	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/22	2020/4/30	0.300	1,020	1,020				

●2020年4月21日の予定

*米国3月の中古住宅販売	*20年利付国債入札(9,000億円、4/22発行)
--------------	----------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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