

# Central Daily Market Report

2020年4月21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21日 需給速報	2020年4月22日 需給予想	2020年4月23日 当社予想
銀行券	▲ 1,500	▲ 1,500	▲ 2,000
財政	2,700	▲ 8,300	5,000
資金過不足	1,200	▲ 9,800	3,000
<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		5,000	
国債買入			
CP等買入		▲ 100	▲ 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			
新型コロナ企業金融支援特別			
E T F買入		900	
国債補完供給	▲ 300	900	300
※ドル資金供給用担保国債供給		▲ 21,600	
当預増減	1,700	▲ 25,300	3,000
当座預金残高	4,114,100	4,088,800	4,091,800
準備預金残高	3,563,200		
積み終了先	3,561,300		4月22日以降の残り所要積立額
超過準備	3,560,300		積数
非準備預金先	550,900		1日平均
			800
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	99.43%	日数
			20.00%

## ●2020年4月21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▲0.075~▲0.015%の出会いが中心となった。一巡後は▲0.065~▲0.060%で調整の出会いが見られるのみであった。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>

GC T/N(4/22-4/23)は、▲0.155~▲0.110%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、5Y136~143、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>

短国買入オペアが、前回から2,500億円増額の5,000億円でオファーされ、平均落札利回較差▲0.004%、按分落札利回較差▲0.013%と、しっかりした結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、引き続き発行案件は膨らまず、発行総額は1,100億円程度と償還総額1,800億円程度を下回った。発行レートは昨日に引き続き、前週比で若干低めの水準で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/4/21	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	▲ 0.043				-	▲ 0.116	0.015	0.005	19,280.78	▲ 388.34	107.67-69	107.38-39
T/N							-	▲ 0.149						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.138						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.144						
3W							-	▲ 0.143						
1M	▲ 0.030	▲ 0.026	▲ 0.028				-	▲ 0.147						
3M							▲ 0.160	▲ 0.150						
6M							▲ 0.176	▲ 0.183						
1Y							▲ 0.185	▲ 0.198						
									日付	4/14	4/15	4/16	4/17	4/20
									日銀当預残	3,980,600	4,052,600	4,076,000	4,102,600	4,112,400
									準備預金残	3,452,800	3,511,200	3,536,100	3,564,000	3,562,600
									マネタリーベース	5,129,300	5,202,000	5,226,700	5,254,500	5,265,800
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.009%	▲0.044%	▲0.046%	▲0.042%
									コール市場残高	120,269	119,271	118,346	118,134	123,033
									うち無担	101,892	101,314	103,332	104,283	106,277
									うちO/N	65,709	65,086	67,539	68,540	70,959
									うち有担	18,377	17,957	15,014	13,851	16,756

## ●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)
20年利付国債	172	0.40%	9,000	2020/4/22	2040/3/20	26,150.0	7,301.0	101.1000	0.3400%	16.5349%	101.2100	0.3350%	1,693.0

## ●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	5,000	2020/4/22			9,244	5,002	▲0.013		▲0.004	2.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/21	2020/4/22	▲0.350	296	296		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/21	2020/4/22	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/23	2020/4/30	0.300	1,290	1,290				
米ドル資金供給		2020/4/23	2020/7/16	0.320	19,903	19,903				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	25,000	2020/4/22	2020/7/17		21,123	21,123		▲0.100	▲0.100	

## ●2020年4月22日の予定

*英国3月の消費者物価指数	*交付税特別会計借入(11,000億円、5/7借入)
---------------	----------------------------

◆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