

Central Daily Market Report

2020年4月22日(水)

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22日		2020年4月23日		2020年4月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,600		▲ 2,200		▲ 3,000	
財政	▲ 7,600		500		12,000	
資金過不足	▲ 9,200		▲ 1,700		9,000	
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	5,000					
国債買入			7,400			
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					1,500	
新型コロナ企業金融支援特別						
E T F買入	900		1,200			
国債補充供給	▲ 100	300		100		
※ドル資金供給用担保提供	▲ 21,600					900
当増減	▲ 24,800		6,600		11,400	
当座預金残高	4,089,300		4,095,900		4,107,300	
準備預金残高	3,530,400					
積み終了先	3,528,500					
超過準備	3,528,500					
非準備預金先	558,900					
			4月23日以降の残り所要積立額			
			積数	16,500		
			1日平均	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	99.49%	日数	23.33%		

●2020年4月22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▲0.060%程度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>

GC T/N(4/23-4/24)は、▲0.165~▲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、20Y167~172、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、3M物が▲0.175~▲0.170%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、鉄鋼1社が600億円程度調達したことを筆頭に、機械や医薬品でも比較的まとまった額の発行が見られ、発行総額は1,300億円程度と償還総額1,100億円程度を上回った。発行レートは全般的に、昨日に引続き、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

2020/4/22	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				-	▲ 0.113	▲ 0.010	▲ 0.025	19,137.95	▲ 142.83	107.71-73	107.59-61
T/N							-	▲ 0.157						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.030				-	▲ 0.148						
2W	▲ 0.005	0.015	0.002				-	▲ 0.149						
3W							-	▲ 0.145						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.150						
3M							▲ 0.170	▲ 0.150						
6M							▲ 0.176	▲ 0.184						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.197						
									日付	4/15	4/16	4/17	4/20	4/21
									日銀当預残	4,052,600	4,076,000	4,102,600	4,112,400	4,114,100
									準備預金残	3,511,200	3,536,100	3,564,000	3,562,600	3,563,200
									マネタリーベース	5,202,000	5,226,700	5,254,500	5,265,800	5,269,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.044%	▲ 0.046%	▲ 0.042%	▲ 0.043%
									コール市場残高	119,271	118,346	118,134	123,033	120,039
									うち無担	101,314	103,332	104,283	106,277	105,605
									うちO/N	65,086	67,539	68,540	70,959	71,137
									うち有担	17,957	15,014	13,851	16,756	14,434

●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)
交付税特会	-	-	11,000	2020/5/7	2020/11/5	229,359.0	11,000.01		0.0000%	4.7960%		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
国債買入(残存期間1年以下)	800	2020/4/23			2,305	802	▲0.002		0.002	90.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,800	2020/4/23			8,308	2,807	▲0.019		▲0.018	83.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/4/23			8,657	3,505	▲0.025		▲0.022	56.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/22	2020/4/23	▲ 0.350	113	113		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/22	2020/4/23	▲ 0.350	8	8		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/4/24	2020/5/7	0.310	971	971				

●2020年4月23日の予定

*2月の景気動向指数改訂状況	*米国3月の新築一戸建て販売件数	*2年利付国債入札(20,000億円、5/1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