

Central Daily Market Report

2020年4月23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23日 需給速報	2020年4月24日 需給予想	2020年4月27日 当社予想
銀行券	▲ 2,300	▲ 1,800	▲ 1,000
財政	2,000	13,300	4,000
資金過不足	▲ 300	11,500	3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			▲ 14,600
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	7,400		
CP等買入		▲ 400	▲ 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	▲ 400
新型コロナウイルス企業金融支援特別			
ETF買入	1,200		
国債補充供給	▲ 100	100	100
米ドル資金供給用担保提供供給			900
当預増減	7,900	13,200	▲ 11,600
当座預金残高	4,097,200	4,110,400	4,098,800
準備預金残高	3,538,500		
積み終了先	3,536,700		
超過準備	3,536,700		
非準備預金先	558,700		
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	99.55%	日数
			26.67%

●2020年4月23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▲0.080～▲0.015%の出会いが中心となった。一巡後は▲0.065%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連休を越える期間で▲0.020%程度での出会いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/N(4/24-4/27)は、▲0.145～▲0.120%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、1Y物が▲0.185%で出合った。

＜CP市場＞

CP発行市場は、電気・ガス業、食料品業態でまとまった額の発行が見られ、発行総額は1,600億円程度と償還総額400億円程度を上回り、発行超のマーケットとなった。発行レートはロットの大きい物や期間の長い物が僅かに上昇したが、全般的には横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2020/4/23	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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				-	▲ 0.105	▲ 0.010	0.000	19,429.44	291.49	107.82-84	107.63-65
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.138						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.142						
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.146						
3W							-	▲ 0.147						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.148						
3M			0.070				▲ 0.170	▲ 0.149						
6M							▲ 0.176	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.195						
									日付	4/16	4/17	4/20	4/21	4/22
									日銀当預残	4,076,000	4,102,600	4,112,400	4,114,100	4,089,300
									準備預金残	3,536,100	3,564,000	3,562,600	3,563,200	3,530,400
									マナタリーベース	5,226,700	5,254,500	5,265,800	5,269,000	5,245,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.044%	▲ 0.046%	▲ 0.042%	▲ 0.043%	▲ 0.043%
									コール市場残高	118,346	118,134	123,033	120,039	122,594
									うち無担	103,332	104,283	106,277	105,605	106,852
									うちO/N	67,539	68,540	70,959	71,137	70,554
									うち有担	15,014	13,851	16,756	14,434	15,742

●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)
2年利付国債	412	0.10%	20,000	2020/5/1	2022/5/1	88,089.0	16,225.00	100.4750	▲0.1360%	25.1523%	100.4830	▲0.1400%	3,771.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/23	2020/4/24	▲ 0.350	95	95		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/23	2020/4/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/27	2020/5/7	0.300	722	722				

●2020年4月24日の予定

*3月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.4%)	*米国3月の耐久財新規受注	*国庫短期証券(903回)入札 (3ヶ月、57,400億円、4/27発行)
*3月の企業向けサービス価格指数		*交付税特別会計借入 (11,000億円、5/8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