

# Central Daily Market Report

2020年4月24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24日 需給速報	2020年4月27日 需給予想	2020年4月28日 当社予想
銀行券	▲ 1,800	▲ 1,800	▲ 2,000
財政	13,600	▲ 3,600	5,000
資金過不足	11,800	▲ 5,400	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			13,400 ▲ 14,600
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			2,000
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	
新型コロナ企業金融支援特別			200
E T F 買入			1,100
国債補完供給	▲ 500	100	500
米ドル資金供給(米ドル提供保証)			900
当増減	13,000	▲ 3,200	3,000
当座預金残高	4,110,200	4,107,000	4,110,000
準備預金残高	3,552,700		
積み終了先	3,551,000		4月27日以降の残り所要積立額
超過準備	3,550,900		積数 9,200
非準備預金先	557,500		1日平均 500
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	99.71%	日数 36.67%

## ●2020年4月24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▲0.065~▲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(4/27-4/28)は、▲0.125~▲0.100%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、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

本日はTB3M物(903回)の入札が実施された。WI取引において▲0.140~▲0.137%での出会いが見られたものの、平均落札利回▲0.1283%、按分落札利回▲0.1142%と、やや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、▲0.145~▲0.1283%出会いと、堅調な推移となった。

### <CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で1,200億円程度調達する先が見られたことで、発行総額は1,900億円程度となったが、償還総額3,500億円を下回り、償還超のマーケットとなった。発行レートは大型案件でも大きく足切りが流れることはなく、落ち着いて推移している。特に発行残高が少ない一部希少銘柄ではレート低下余地を探る動きが見られた。本日はCP等買入オベが、事前予定額より2,000億円多い、6,000億円でおファーされた。結果は、平均落札レート0.081%、按分落札レート0.052%と、前回(平均0.164%、按分0.106%)比で平均・按分ともに低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2020/4/24	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	▲ 0.047				-	▲ 0.111	▲ 0.025	▲ 0.015	19,262.00	▲ 167.44	107.66-67	107.69-70
T/N							-	▲ 0.115						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.133						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.133						
3W							-	▲ 0.136						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.147	▲ 0.146						
6M							▲ 0.176	▲ 0.179						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.193						
									日付	4/17	4/20	4/21	4/22	4/23
									日銀当預残	4,102,600	4,112,400	4,114,100	4,089,300	4,097,200
									準備預金残	3,564,000	3,562,600	3,563,200	3,530,400	3,538,500
									マネタリーベース	5,254,500	5,265,800	5,269,000	5,245,800	5,256,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.042%	▲ 0.043%	▲ 0.043%	▲ 0.046%
									コール市場残高	118,134	123,033	120,039	122,594	124,700
									うち無担	104,283	106,277	105,605	106,852	108,683
									うちO/N	68,540	70,959	71,137	70,554	70,695
									うち有担	13,851	16,756	14,434	15,742	16,017

## ●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	903	-	57,400	2020/4/27	2020/7/27	163,225.0	46,577.80	100.0285	▲0.1142%	53.1050%	100.0320	▲0.1283%	10,822.0
交付税特会	-	-	11,000	2020/5/8	2020/11/9	231,054.0	11,000.03		0.0000%	4.7609%		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	
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2020/4/27	2020/5/11		13,371	13,371					
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,200	2020/4/27			4,303	1,205	▲0.014		▲0.013	96.6	
国債買入(残存期間25年超)	300	2020/4/27			834	302	▲0.018		▲0.016	31.3	
国債買入(物価連動債)	300	2020/4/27			1,548	300		▲0.110	▲0.214		
CP等買入	6000	2020/4/30			14,100	6,000	0.052		0.081	94.7	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/24	2020/4/27	▲ 0.350	469	469		▲ 0.350	▲ 0.350		
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/24	2020/4/27	▲ 0.350	0	0					
米ドル資金供給		2020/4/28	2020/5/7	0.310	310	310					
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)							
新型コロナ企業金融支援特別オペ	第3回	2020/4/27	2020/7/27	0	178						

## ●2020年4月27日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(終了後、直ちに結果公表)	*黒田日銀総裁定例会見	*経済・物価情勢の展望
◆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		