

# Central Daily Market Report

2020年4月28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28日 需給速報	2020年4月30日 需給予想	2020年5月1日 当社予想			
銀行券	▲ 3,100	▲ 3,700	▲ 3,000			
財政	5,000	3,200	▲ 28,000			
資金過不足	1,900	▲ 500	▲ 31,000			
<b>金融調節</b>						
	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			10,400			
CP等買入		▲ 400	6,000	▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
新型コロナ企業金融支援特別						
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 700	1,000		700		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 5,600			
当預増減	2,200		15,000		▲ 31,000	
当座預金残高	4,109,300		4,124,300		4,093,300	
準備預金残高	3,536,100					
積み終了先	3,535,400					
超過準備	3,535,100					
非準備預金先	573,200					
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	99.83%	日数	46.67%		

## ●2020年4月28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~▲0.020%の出会いが中心となった。一巡後は▲0.070~▲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(4/30-5/1)は、▲0.160~▲0.125%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>

本日のアウトライト市場は、短国買入オペアが前回と同額の5,000億円でおファーされた。平均落札利回較差+0.003%、按分落札利回較差▲0.005%と、無難な結果となった。マーケットでは、動意なく閑散な中、3M物が▲0.155%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は、月初発行にあたり、輸送用機器・商社等からまとまった発行が実施された。償還総額900億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度となった。発行レートは、昨日の金融政策決定会合を受け、全体的に目線を切り下げる動きが見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2020/4/28	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	▲ 0.048				-	▲ 0.113	▲ 0.050	▲ 0.011	19,771.19	▲ 12.03	107.29-30	107.07-08
T/N	▲ 0.150	▲ 0.087	▲ 0.138				-	▲ 0.169						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.161						
2W	0.001	0.100	0.089				-	▲ 0.150						
3W							-	▲ 0.147						
1M							-	▲ 0.151						
3M							▲ 0.153	▲ 0.153						
6M							▲ 0.176	▲ 0.182						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.196						
									日付	4/21	4/22	4/23	4/24	4/27
									日銀当預残	4,114,100	4,089,300	4,097,200	4,110,200	4,107,100
									準備預金残	3,563,200	3,530,400	3,538,500	3,552,700	3,562,300
									マネタリーベース	5,269,000	5,245,800	5,256,000	5,270,900	5,269,800
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.043%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%
									コール市場残高	120,039	122,594	124,700	121,854	124,853
									うち無担	105,605	106,852	108,683	106,740	105,822
									うちO/N	71,137	70,554	70,695	68,812	68,249
									うち有担	14,434	15,742	16,017	15,114	19,031

## ●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
国庫短期証券買入	5,000	2020/4/30			7,773	5,000	▲0.005		0.003	77.2
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,400	2020/4/30			5,941	3,400	▲0.010		▲0.003	61.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2020/4/30			7,646	3,005	▲0.005		▲0.004	49.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,700	2020/4/30			8,738	3,704	▲0.011		▲0.010	30.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/28	2020/4/30	▲ 0.350	724	724		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/28	2020/4/30	▲ 0.350	10	10		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/4/30	2020/5/14	0.320	6,670	6,670				
米ドル資金供給		2020/4/30	2020/7/16	0.330	1,016	1,016				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	10,000	2020/4/30	2020/5/15		5,479	5,479		▲ 0.100	▲ 0.100	

## ●2020年4月30日の予定

*3月の商業動態統計速報	*米国3月の個人所得・消費支出	*ECB定例理事会
*3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲5.2%)	*米国4月のシカゴPM景況感指数	
*3月の住宅着工統計	*4月の消費動向調査	*ユーロ圏4月の消費者物価指数

◆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