Central Daily Market Report

2020年3月23日（月）
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3月23日 需給速報		2020年3月24日 需給予想		2020年3月25日 当社予想	
銀行券	600		▲ 100		0	
財政	87,000		▲ 500		▲ 3,000	
資金過不足	87,600		▲ 600		▲ 3,000	
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	1,500					
国債買現						
国債売現			▲ 8,000			
国庫短期証買入			2,500			
国債買入	13,500		9,800			
CP等買入		▲ 400	5,000	▲ 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						
ＥＴＦ買入	100		200			
国債補完供給	▲ 18,700	3,600		18,700		
※ドル資金供給用担保国債供給			▲ 43,100			
当預増減	87,200		▲ 15,600		▲ 3,000	

当座預金残高	4,023,400	4,007,800	4,004,800
準備預金残高	3,518,100		
積み終了先	3,514,100	3月24日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,513,500	積数	18,700
非準備預金先	505,300	1日平均	800
積み期間（3/16～4/15）の所要準備額			3,247,700
準備預金進捗率	実績 99.42%	日数	25.81%

●2020年3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、地銀・証券業態を中心に▲0.07～▲0.01%とワイドレンジの出合いとなった。一部の先で資金を厚めに積む動きが見られたことで全体のレートも上昇した。ターム物は引き続きオファーが薄く、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/24-3/25)は、▲0.90～▲0.50%程度での出合い。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2Y402～410、5Y136～142、10Y335～357、20Y167～171、30Y59～65、40Y9～12等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、急低下。アウトライト市場は、短国買入オペが2,500億円（前回比▲2,500億円）、応募上限額1,250億円でオファーされた。平均落札利回較差▲0.027%、按分落札利回較差▲0.062%と、応募上限額が少額だったことや、債券相場全体が堅調なこともあってか、強めの結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.420～▲0.325%、6M物が▲0.325～▲0.285%、1Y物が▲0.290～▲0.280%で出合った。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、5,500億円程度の償還に対して、2,700億円強の発行となり償還超。鉄鋼・不動産等が大ロットの発行を実施した。発行レートは、市場残高の増加を受け、引き続き総じて上昇傾向が見られている。

●短期金融市場関連指標

2020/3/23	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.048				－	▲ 0.536
T/N	▲ 0.040	0.000	▲ 0.026				－	▲ 0.620
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.018				－	▲ 0.335
2W							－	▲ 0.337
3W							－	▲ 0.302
1M			0.030				－	▲ 0.282
3M							▲ 0.420	▲ 0.271
6M							▲ 0.330	▲ 0.266
1Y							▲ 0.280	▲ 0.265

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.065	▲ 0.025	16,887.78	334.95	110.38-42	110.23-25

日付	3/13	3/16	3/17	3/18	3/19
日銀当預残	3,912,400	3,908,400	3,899,300	3,910,200	3,936,200
準備預金残	3,430,400	3,413,300	3,413,100	3,415,900	3,437,200
マネタリーベース	5,053,000	5,048,800	5,040,000	5,051,600	5,078,800
無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.068%	▲0.068%	▲0.063%	▲0.051%
コール市場残高	128,813	118,326	115,143	117,221	128,301
うち無担	116,160	98,338	102,748	106,619	117,668
うちO/N	81,012	67,495	71,975	73,811	76,770
うち有担	12,653	19,988	12,395	10,602	10,633

●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Ｉ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	2,500	2020/3/24			5,226	2,500	▲0.062		▲0.027	26.6
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,000	2020/3/24			5,143	3,000	▲0.053		▲0.037	76.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	5,000	2020/3/24			6,913	5,000	▲0.065		▲0.045	4.8
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,200	2020/3/24			1,939	1,201	▲0.054		▲0.031	53.3
国債買入（残存期間25年超）	300	2020/3/24			993	302	▲0.019		▲0.017	66.7
社債等買入	2000	2020/3/27			3,708	2,001	0.082		0.113	63.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/3/23	2020/3/24	▲ 0.550	17,619	17,619		▲0.550	▲0.550	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/3/23	2020/3/24	▲ 0.550	653	653		▲0.550	▲0.550	
米ドル資金供給		2020/3/25	2020/4/1	0.380	34,850	34,850				
国債売現先	8,000	2020/3/24	2020/3/31		30,000	8,000	▲0.170		▲0.204	50.0
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	45,000	2020/3/24	2020/4/2		42,559	42,559		▲0.100	▲0.100	

●2020年3月24日の予定

*米国2月の新築一戸建て販売件数

*流動性供給入札
（4,000億円、3/25発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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