

Central Daily Market Report

2020年3月25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3月25日 需給速報	2020年3月26日 需給予想	2020年3月27日 当社予想
銀行券	▲ 500	▲ 1,400	▲ 1,000
財政	15,900	14,900	▲ 5,000
資金過不足	15,400	13,500	▲ 6,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出		▲ 100	
全店共通			
国債買現			
国債売現	▲ 8,000	▲ 4,000	
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲ 700	▲ 600
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			2,000
新型コロナウイルス金融支援特別	34,000		
E T F 買入	900	600	
国債補完供給	▲ 5,600	22,400	5,900
米ドル資金供給用担保国債供給	▲ 98,200	▲ 2,700	2,400
当増減	▲ 39,900	12,700	▲ 1,600
当座預金残高	3,943,700	3,956,400	3,954,800
準備預金残高	3,431,800		
積み終了先	3,430,600		3月26日以降の残り所要積立額
超過準備	3,430,300		積数 13,800
非準備預金先	511,900		1日平均 700
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	99.58%	日数 32.26%

●2020年3月25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・証券業態を中心に▲0.07~▲0.005%とワイドレンジの出会いとなった。ビッドサイドの調達ニーズはさらに強まっており、全体の上昇スピードは早い。ターム物は引き続きオファーが薄く、目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(3/26-3/27)は、▲0.30~▲0.20%程度での出会い。本日の国債売現先オペアは、期末初物と期末越え1W物でのオファーとなった。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、上昇。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、6M物が▲0.310%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、電機・ノンバンク等から大型発行が実施されたものの、償還総額4,600億円弱に対して、発行総額は1,500億円程度にとどまった。発行レートは全体的に上昇傾向が継続しているが、銘柄毎にやや差がつく展開となっている。

●短期金融市場関連指標

2020/3/25	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	▲ 0.028				-	▲ 0.229	0.030	▲ 0.005	19,546.63	1,454.28	111.10-14	111.46-47
T/N	▲ 0.015	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.284						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.401						
2W							-	▲ 0.319						
3W							-	▲ 0.311						
1M							-	▲ 0.284						
3M							▲ 0.440	▲ 0.277						
6M							▲ 0.335	▲ 0.272						
1Y							▲ 0.293	▲ 0.270						
									日付	3/17	3/18	3/19	3/23	3/24
									日銀当預残	3,899,300	3,910,200	3,936,200	4,023,400	3,983,600
									準備預金残	3,413,100	3,415,900	3,437,200	3,518,200	3,469,500
									マネタリーベース	5,040,000	5,051,600	5,078,800	5,165,400	5,125,500
									無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.063%	▲0.051%	▲0.048%	▲0.039%
									コール市場残高	115,143	117,221	128,301	130,142	124,350
									うち無担	102,748	106,619	117,668	121,986	116,487
									うちO/N	71,975	73,811	76,770	81,458	80,484
									うち有担	12,395	10,602	10,633	8,156	7,863

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/25	2020/3/26	▲ 0.55	5,516	5,182		▲0.550	▲0.644	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/25	2020/3/26	▲ 0.55	255	255		▲0.550	▲0.550	
米ドル資金供給		2020/3/27	2020/4/3	0.34	4,950	4,950				
国債売現先	4,000	2020/3/26	2020/4/3		24,300	4,000		▲0.550	▲0.550	
国債売現先	20,000	2020/3/31	2020/4/1		27,400	20,000	▲0.150		▲0.429	30.0
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2020/3/26	2020/4/6		2,678	2,678		▲0.100	▲0.100	

●2020年3月26日の予定

*月例経済報告	*英中銀MPC結果発表	*40年利付国債入札(4,000億円、3/27発行)
*2月の企業向けサービス価格指数	*米国10-12月期のGDP確報値	

◆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