Central Daily Market Report

2020年3月27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3月27日 需給速報		2020年3月30日 需給予想		2020年3月31日 当社予想	
銀行券	▲ 900		▲ 500		1,000	
財政	▲ 4,300		40,100		8,400	
資金過不足	▲ 5,200		39,600		9,400	
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			10,800	▲ 8,800		
国債買現						
国債売現	▲ 8,000		▲ 8,000		▲ 20,000	16,000
国庫短期証買入						
国債買入			11,500			
CP等買入		▲ 600		▲ 700	5,500	
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					
新型コロナ企業金融支援特別						
ＥＴＦ買入	1,000		300			
国債補完供給	▲ 1,600	3,400		1,600		
※ドル資金供給用担保国債供給	▲ 1,400	2,500	▲ 15,800			
当預増減	▲ 7,900		30,500		10,900	

当座預金残高	3,945,700	3,976,200	3,987,100
準備預金残高	3,418,000		
積み終了先	3,417,300		
超過準備	3,416,000		
非準備預金先	527,700		

3月30日以降の残り所要積立額	
積数	6,400
1日平均	400

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	99.80%	日数 45.16%

●2020年3月27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▲0.03～▲0.001%の出合いとなった。引き続きビッドサイドの調達ニーズが強いことに加え、3日積みということもあり、前日比でレートは上昇した。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(3/30-3/31)は、▲0.18～▲0.13%程度での出合い。本日の国債売現先オペは、期末越え3日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、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.310～▲0.290%での出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.1884%、按分落札利回▲0.1022%とテールが大きく流れる弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.190～▲0.140%出合いの推移となった。

<CP市場>

現先レートは横ばい圏で推移した。CP発行市場は、年度末発行となった。電機・機械等幅広い業態が大型発行を実施したが、3兆6,000億円程度の償還に対して、発行は9,000億円弱にとどまるなど、例年通り大幅な償還超となった。発行レートについては、引き続き高いレート水準で決着する案件が増加し、札割れとなる案件も多く見られた。

●短期金融市場関連指標

2020/3/27	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	▲ 0.017				－	▲ 0.126
T/N	▲ 0.005	0.000	▲ 0.005				－	▲ 0.160
S/N			▲ 0.001				－	－
1W							－	▲ 0.189
2W			0.180				－	▲ 0.185
3W			0.200				－	▲ 0.185
1M							－	▲ 0.188
3M							▲ 0.180	▲ 0.202
6M							▲ 0.230	▲ 0.251
1Y							▲ 0.220	▲ 0.259

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）
0.005	0.003	19,389.43	724.83	109.13-17	108.90-92

日付	3/19	3/23	3/24	3/25	3/26
日銀当預残	3,936,200	4,023,400	3,983,600	3,943,700	3,953,600
準備預金残	3,437,200	3,518,200	3,469,500	3,434,000	3,436,800
マネタリーベース	5,078,800	5,165,400	5,125,500	5,086,100	5,097,600
無担O/N加重平均	▲0.051%	▲0.048%	▲0.039%	▲0.028%	▲0.020%
コール市場残高	128,301	130,142	124,350	127,148	129,184
うち無担	117,668	121,986	116,487	118,396	121,727
うちO/N	76,770	81,458	80,484	83,393	85,824
うち有担	10,633	8,156	7,863	8,752	7,457

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	897	－	47,400	2020/3/30	2020/6/29	81,596.5	38,558.9	100.0255	▲0.1022%	4.1666%	100.0470	▲0.1884%	8,841.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2020/3/30	2020/4/13		10,770	10,770				
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,200	2020/3/30			10,706	4,205	0.025		0.027	46.3
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,400	2020/3/30			7,856	3,403	▲0.004		0.006	81.8
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,500	2020/3/30			9,335	3,502	0.000		0.004	16.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2020/3/27	2020/3/30	▲ 0.350	1,478	1,478		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2020/3/27	2020/3/30	▲ 0.350	69	69		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2020/3/31	2020/4/7	0.340	13,100	13,100				
国債売現先	8,000	2020/3/30	2020/4/2		26,500	8,000		▲0.210	▲0.240	
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	20,000	2020/3/30	2020/4/8		15,437	15,437		▲0.100	▲0.100	

●2020年3月30日の予定

特にありません。

◆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