

Central Daily Market Report

2020年3月31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3月31日 需給速報	2020年4月1日 需給予想	2020年4月2日 当社予想
銀行券	0	▲ 200	0
財政	10,800	▲ 25,400	3,000
資金過不足	10,800	▲ 25,600	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						
国債買現						
国債売現	▲ 20,100	16,000		20,100		8,000
国庫短期証買入			2,500			
国債買入						
CP等買入	5,500	▲ 4,200				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ企業金融支援特別						
E T F買入	200		200			
国債補完供給	▲ 8,600	1,900		8,600		
米ドル資金供給用担保国債供給	▲ 21,800		▲ 40,600			42,600
当増減	▲ 20,300		▲ 34,800			53,600

当座預金残高	3,952,600	3,917,800	3,971,400
準備預金残高	3,443,700		
積み終了先	3,441,600	4月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,441,400	積数	3,500
非準備預金先	508,900	1日平均	200

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 99.89% 日数 51.61%

●2020年3月31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▲0.087~▲0.04%の出会いとなった。期末初の取引となり調達を見送った先が多く、ギブン地合いとなるなか出会いレートは大幅に低下し、市場残高も減少した。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(4/1-4/2)は、▲0.26~▲0.10%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2Y402~410、5Y136~142、10Y335~357、20Y167~171、30Y59~65、40Y9~12等にビッグの出入りがあった。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、急上昇。アウトライト市場は、短国買入オペアが前回と同額の2,500億円でオファーされた。平均落札利回較差+0.002%、按分落札利回較差▲0.014%と、しっかりした結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.229%、1Y物が▲0.160%で出合った。

<CP市場>

現先レートは、概ね横ばい圏で推移した。CP発行市場は、発行総額は3,500億円程度であった。投資家の慎重姿勢が強まっているため、銘柄ごとに較差はあるものの、全体的な発行レートの上昇と札割れが継続している。

●短期金融市場関連指標

2020/3/31	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	▲ 0.070				-	▲ 0.615	0.010	0.010	18,917.01	▲ 167.96	108.07-09	108.41-43
T/N							-	▲ 0.243						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.198						
2W							-	▲ 0.196						
3W							-	▲ 0.195						
1M	0.000	0.005	0.003				-	▲ 0.200						
3M								▲ 0.229						
6M								▲ 0.170						
1Y								▲ 0.160						

日付	3/24	3/25	3/26	3/27	3/30
日銀当預残	3,983,600	3,943,700	3,953,600	3,945,700	3,972,900
準備預金残	3,469,500	3,434,000	3,436,800	3,418,400	3,435,900
マネタリーベース	5,125,500	5,086,100	5,097,600	5,090,600	5,118,400
無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.028%	▲ 0.020%	▲ 0.017%	▲ 0.017%
コール市場残高	124,350	127,148	129,184	127,519	121,840
うち無担	116,487	118,396	121,727	116,856	114,136
うちO/N	80,484	83,393	85,824	82,973	80,583
うち有担	7,863	8,752	7,457	10,663	7,704

●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)
2年利付国債	411	0.10%	20,000	2020/4/1	2022/4/1	69,498.0	16,224.0	100.4250	▲0.1120%	25.3830%	100.4520	▲0.1250%	3,771.0

●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
国庫短期証券買入	2,500	2020/4/1			6,756	2,501	▲0.014		0.002	25.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/3/31	2020/4/1	▲ 0.850	8,383	8,383		▲ 0.850	▲ 0.851	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/3/31	2020/4/1	▲ 0.850	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/2	2020/4/9	0.320	9,285	9,285				
米ドル資金供給		2020/4/2	2020/6/25	0.320	29,724	29,724				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	15,000	2020/4/1	2020/4/10		10,798	10,798		▲ 0.100	▲ 0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	35,000	2020/4/1	2020/6/26		28,876	28,876		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2020年4月1日の予定

*3月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*米国2月の建設支出
	*米国3月のISM製造業景況指数

◆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