

Central Daily Market Report

2020年4月8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4月8日 需給速報	2020年4月9日 需給予想	2020年4月10日 当社予想
銀行券	100	▲ 1,000	0
財政	▲ 8,800	▲ 700	▲ 15,000
資金過不足	▲ 8,700	▲ 1,700	▲ 15,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	2,500		
国債買入		6,800	
CP等買入		▲ 300	
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	300	1,500	
国債補充供給	▲ 700	2,300	700
※ドル資金供給用担保提供供給	▲ 34,700	15,800	21,800
当預増減	▲ 23,200	28,800	▲ 4,200
当座預金残高	3,943,100	3,971,900	3,967,700
準備預金残高	3,402,400		
積み終了先	3,402,300		
超過準備	3,402,300		
非準備預金先	540,700		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,255,300
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数
			77.42%

●2020年4月8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~▲0.02%での調達で始まった。昨日に続き調達レートは低下傾向で、一巡後は▲0.07%近辺の出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/N(4/9-4/10)は、▲0.45~▲0.20%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2Y402~411、5Y136~142、10Y335~358、20Y167~171、30Y59~65、40Y9~12等にビッグの出入りがあった。

<短国市場>

アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.170~▲0.160%で出会った。

<CP市場>

発行市場は償還総額500億円程度に対して、発行総額は800億円程度と発行超であった。複数業態において案件が見られたものの、減額された発行が見られ、やや閑散としたマーケットとなった。発行レートは引き続き銘柄によりばらつきがあり、方向感を探る展開となった。

●短期金融市場関連指標

2020/4/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.150	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.233	0.010	0.009	19,353.24	403.06	108.66-69	108.83-85
T/N			▲ 0.080				-	▲ 0.408						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.275						
2W							-	▲ 0.243						
3W							-	▲ 0.241						
1M	0.070	0.300	0.185				-	▲ 0.249						
3M			0.050				▲ 0.160	▲ 0.205						
6M							▲ 0.150	▲ 0.226						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.233						
									日付	4/1	4/2	4/3	4/6	4/7
									日銀当預残	3,917,000	3,956,200	3,960,700	3,962,600	3,966,300
									準備預金残	3,399,800	3,440,400	3,445,300	3,441,900	3,426,500
									マネタリーベース	5,062,800	5,103,200	5,108,000	5,109,100	5,113,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.020%	▲ 0.017%	▲ 0.022%	▲ 0.035%
									コール市場残高	119,308	117,869	123,580	108,317	114,438
									うち無担	103,368	108,291	107,986	101,150	103,852
									うちO/N	79,685	80,603	77,398	70,007	71,669
									うち有担	15,940	9,578	15,594	7,167	10,586

●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)
交付税特会	-	-	11,000	2020/4/17	2020/10/16	249,851.0	11,000.24		0.0000%	4.4028%		0.0000%	

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,200	2020/4/9			9,621	3,201	▲0.004		0.001	44.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/4/9			8,518	3,508	0.007		0.010	65.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/8	2020/4/9	▲ 0.350	738	738		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/8	2020/4/9	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/10	2020/4/17	0.300	1,080	1,080				

●2020年4月9日の予定

*3月の消費動向調査	*米国2月の卸売売上高 *米国3月の生産者物価指数 *米国4月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(899回)入札(6ヶ月、29,000億円、4/10発行) *5年利付国債入札(19,000億円、4/10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きます。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