

Central Daily Market Report

2020年4月10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4月10日 需給速報	2020年4月13日 需給予想	2020年4月14日 当社予想
銀行券	▲ 300	700	0
財政	▲ 18,400	▲ 6,700	2,000
資金過不足	▲ 18,700	▲ 6,000	2,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		14,600	▲ 14,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲ 100	▲ 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		1,500	▲ 100
新型コロナウイルス企業金融支援特別		5,600	
E T F買入	3,100	900	
国債補完供給	▲ 300	2,300	300
米ドル資金供給用担保提供		11,100	400
当預増減	▲ 2,600	2,800	2,400
当座預金残高	3,969,200	3,972,000	3,974,400
準備預金残高	3,421,400		
積み終了先	3,421,300		4月13日以降の残り所要積立額
超過準備	3,421,300		積数
非準備預金先	547,800		1日平均
			200
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	99.98%	日数
			90.32%

●2020年4月10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▲0.045~▲0.01%での調達で始まった。積み終盤の取り調整の動きに加え、週末要因も重なったことでレート水準が上昇した。一巡後は▲0.04%近辺の出合いが散見される程度で、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは20,000億円(4/13~4/27)オファーされ、応募額14,570億円(期落ち分14,270億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(4/13-4/14)は、▲0.10~▲0.07%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等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

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▲0.150~▲0.140%で出合中、平均落札利回▲0.1431%、按分落札利回▲0.1202%と、軟調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットにおいては、▲0.150~▲0.140%出合いと落ち着いた推移となった。

<CP市場>

CP発行市場は、償還は850億程度で、発行総額は200億円程度であり、引き続き減額発行が散見された。発行レートは、引き続き水準は高いものの、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2020/4/10	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.094	▲ 0.005	▲ 0.014	19,498.50	152.73	108.50-60	108.38-42
T/N							-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.124						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.139						
3W							-	▲ 0.158						
1M	▲ 0.007	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.164						
3M							▲ 0.152	▲ 0.171						
6M							▲ 0.190	▲ 0.209						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.219						
									日付	4/3	4/6	4/7	4/8	4/9
									日銀当預残	3,960,700	3,962,600	3,966,300	3,943,100	3,971,800
									準備預金残	3,445,300	3,441,900	3,426,500	3,402,400	3,428,200
									マネタリーベース	5,108,000	5,109,100	5,113,400	5,090,100	5,120,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.022%	▲ 0.035%	▲ 0.046%	▲ 0.048%
									コール市場残高	123,580	108,317	114,438	108,685	110,069
									うち無担	107,986	101,150	103,852	101,522	102,607
									うちO/N	77,398	70,007	71,669	68,959	69,324
									うち有担	15,594	7,167	10,586	7,163	7,462

●入札結果

名称	回数	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)
国庫短期証券	900	-	50,400	2020/4/13	2020/7/13	154,998.0	40,905.50	100.0300	▲0.1202%	27.5913%	100.0357	▲0.1431%	9,494.0
エネルギー対策	-	-	8,500	2020/4/20	2021/4/20	130,800.0	8,499.99		0.0000%	6.4985%		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	応募総額(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	2020/4/13	2020/4/27		14,570	14,570				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/10	2020/4/13	▲ 0.350	222	222		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/10	2020/4/13	▲ 0.350	46	46		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/4/14	2020/4/21	0.300	600	600				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
新型コロナウイルス企業金融支援特別オペ	第2回	2020/4/13	2020/7/13	0	5,628

●2020年4月13日の予定

*3月のマネーストック

*EURO、London祝日(Easter Monday)

◆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