

Central Daily Market Report

2020年4月13日(月)
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13日		2020年4月14日		2020年4月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		▲ 400		0	
財政	▲ 5,900		▲ 4,700		78,000	
資金過不足	▲ 5,600		▲ 5,100		78,000	
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	14,600	▲ 14,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,800			
CP等買入		▲ 100		▲ 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	1,500	▲ 100				
新型コロナウイルス金融支援特別	5,600					
E T F 買入	900		800			
国債補完供給	▲ 1,100	300		1,100		
米ドル資金供給用担保提供供給		400		400		6,100
当預増減	2,100		6,800		84,100	
当座預金残高	3,971,300		3,978,100		4,062,200	
準備預金残高	3,443,600					
積み終了先	3,443,500				4月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,443,500				積数	400
非準備預金先	527,700				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	99.99%	日数	93.55%		

●2020年4月13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▲0.025~▲0.01%での調達で始まった。積み期間の最終週に入ったことで、着地に向けた調達ニーズが強まり、出会いレートが上昇した。一巡後も朝方と同水準のレートで散発的な出会いが見られた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(4/14-4/15)は、▲0.10~▲0.07%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2Y402~411、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、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は2,600億円程度、発行総額は1,200億円程度であり、引き続き減額発行が散見された。発行レートは、引き続き銘柄間の格差が大きい結果となった。

●短期金融市場関連指標

2020/4/13	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.085	0.000	0.005	19,043.40	▲ 455.10	108.33-35	107.88-90
T/N							-	▲ 0.094						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.112						
2W			0.001				-	▲ 0.121						
3W							-	▲ 0.146						
1M							-	▲ 0.152						
3M							▲ 0.152	▲ 0.158						
6M							▲ 0.190	▲ 0.205						
1Y							▲ 0.168	▲ 0.216						
									日付	4/6	4/7	4/8	4/9	4/10
									日銀当預残	3,962,600	3,966,300	3,943,100	3,971,800	3,969,200
									準備預金残	3,441,900	3,426,500	3,402,400	3,428,200	3,421,400
									マネタリーベース	5,109,100	5,113,400	5,090,100	5,120,100	5,117,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.035%	▲ 0.046%	▲ 0.048%	▲ 0.032%
									コール市場残高	108,317	114,438	108,685	110,069	124,359
									うち無担	101,150	103,852	101,522	102,607	105,994
									うちO/N	70,007	71,669	68,959	69,324	71,861
									うち有担	7,167	10,586	7,163	7,462	18,365

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,200	2020/4/14			8,434	3,201	▲0.009		▲0.007	26.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	2,800	2020/4/14			7,008	2,804	▲0.007		▲0.005	86.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,500	2020/4/14			9,777	3,506	▲0.006		▲0.004	26.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/13	2020/4/14	▲ 0.350	995	995		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/13	2020/4/14	▲ 0.350	46	46		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2020/4/15	2020/4/22	0.300	931	931				

●2020年4月14日の予定

*流動性供給入札(5,000億円、4/15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