

Central Daily Market Report

2020年4月15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15日		2020年4月16日		2020年4月17日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	82,600		4,300		2,000	
資金過不足	82,000		3,200		1,000	
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						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入			4,000			
CP等買入		▲ 300			5,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					1,300	▲ 1,300
社債等買入						
新型コロナ企業金融支援特別						
E T F買入	900					
国債補完供給		600				
米ドル資金供給用担保提供	▲ 20,000	6,300		15,200		10,800
当増減	72,000		22,400		17,300	
当座預金残高	4,052,600		4,075,000		4,092,300	
準備預金残高	3,511,200					
積み終了先	3,511,200		4月16日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,511,000		積数		3,209,400	
非準備預金先	541,400		1日平均		107,000	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,209,400	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2020年4月15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▲0.01~▲0.003%での調達で始まった。年金定時払いで大幅な資金余剰日となったものの、引き続き着地に向けた調整の調達ニーズが強く、一巡後も朝方と横ばい圏のレートでの出合いが見られ、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で▲0.01%近辺の出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/N(4/16-4/17)は、▲0.13~▲0.10%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、動意なく閑散な中、3M物が▲0.145%で出合った。

<CP市場>

CP発行市場は、償還総額は500億程度、発行総額は1,200億円程度となった。引き続き減額発行が散見され、発行レートは高水準となった。

●短期金融市場関連指標

2020/4/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.087	0.015	0.006	19,550.09	▲ 88.72	107.11-13	107.35-36
T/N							-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.122						
3W							-	▲ 0.130						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.140						
3M							▲ 0.150	▲ 0.149						
6M							▲ 0.175	▲ 0.193						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.205						
									日付	4/8	4/9	4/10	4/13	4/14
									日銀当預残	3,943,100	3,971,800	3,969,200	3,971,300	3,980,600
									準備預金残	3,402,400	3,428,200	3,421,400	3,443,600	3,452,800
									マネタリーベース	5,090,100	5,120,100	5,117,700	5,119,600	5,129,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.048%	▲ 0.032%	▲ 0.019%	▲ 0.010%
									コール市場残高	108,685	110,069	124,359	117,152	120,269
									うち無担	101,522	102,607	105,994	99,367	101,892
									うちO/N	68,959	69,324	71,861	64,884	65,709
									うち有担	7,163	7,462	18,365	17,785	18,377

●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年以下)	800	2020/4/16			2,799	801	0.007		0.009	47.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,200	2020/4/16			11,777	3,204	0.006		0.007	36.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/15	2020/4/16	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/15	2020/4/16	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2020/4/17	2020/4/24	0.300	1,260	1,260				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第108回 2020/4/17	2021/4/16	0	1,068
被災地金融支援オペ(熊本)	第47回 2020/4/17	2021/4/16	0	200

●2020年4月16日の予定

*米国3月の住宅着工件数	*国庫短期証券(901回)入札(1年、19,000億円、4/20発行)
	*流動性供給入札(5,000億円、4/17発行) *交付税特別会計借入(11,000億円、4/24借入)

◆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