

# Central Daily Market Report

2020年4月30日(木)  
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30日		2020年5月1日		2020年5月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,700		▲ 1,300		3,000	
財政	2,900		▲ 28,100		▲ 61,000	
資金過不足	▲ 800		▲ 29,400		▲ 58,000	
<b>金融調節</b>	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	5,000					
国債買入	10,400					
CP等買入	6,000	▲ 900		▲ 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		▲ 100				
新型コロナ企業金融支援特別						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 2,000	700		2,000		
米ドル資金供給用担保提供供給	▲ 5,600					
当預増減	12,700		▲ 27,500		▲ 58,000	
当座預金残高	4,122,000		4,094,500		4,036,500	
準備預金残高	3,520,300					
積み終了先	3,519,500				5月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,519,500				積数	4,600
非準備預金先	601,700				1日平均	300
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	99.86%	日数	50.00%		

## ●2020年4月30日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.087~▲0.030%の出会いが中心となった。月末要因から調達を見送る先が多く、出会い水準は低下した。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>

GC T/N(5/1-5/7)は、▲0.150~▲0.095%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、5Y136~143、10Y335~358、20Y167~172、30Y59~66、40Y9~12等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

本日の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600億円程に対して、石油・鉄鋼から大型発行が見られ、発行総額1,500億円に膨らんだ。発行レートは引き続きボラタイルな展開となっているものの、総じて前日から大きな目線の変更は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/4/30	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	▲ 0.060				-	▲ 0.134	▲ 0.042	0.008	20,193.69	422.50	106.61-62	106.59-61
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.132						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.133						
2W	▲ 0.025	0.003	▲ 0.016				-	▲ 0.135						
3W							-	▲ 0.140						
1M	▲ 0.005	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.145						
3M							▲ 0.150	▲ 0.146						
6M							▲ 0.176	▲ 0.181						
1Y							▲ 0.200	▲ 0.198						
									日付	4/22	4/23	4/24	4/27	4/28
									日銀当預残	4,089,300	4,097,200	4,110,200	4,107,100	4,109,300
									準備預金残	3,530,400	3,538,500	3,552,700	3,562,300	3,536,100
									マネタリーベース	5,245,800	5,256,000	5,270,900	5,269,800	5,275,200
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.048%
									コール市場残高	122,594	124,700	121,854	124,853	122,113
									うち無担	106,852	108,683	106,740	105,822	109,417
									うちO/N	70,554	70,695	68,812	68,249	68,459
									うち有担	15,742	16,017	15,114	19,031	12,696

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/4/30	2020/5/1	▲ 0.450	1,917	1,917		▲ 0.450	▲ 0.452	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/4/30	2020/5/1	▲ 0.450	0	0				
米ドル資金供給		2020/5/7	2020/5/14	0.290	2,042	2,042				

## ●2020年5月1日の予定

*4月の都区部消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.1%	*EURO祝日(Labour Day) *米国3月の建設支出 *米国4月のISM製造業景況指数	*国庫短期証券(904回)入札 (3ヶ月、72,400億円、5/7発行) *流動性供給入札 (4,000億円、5/7発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、5/15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