

# Central Daily Market Report

2019年4月2日(火)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2019年4月2日		2019年4月3日		2019年4月4日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	500		600		0	
財政	▲ 19,200		▲ 20,900		4,000	
資金過不足	▲ 18,700		▲ 20,300		4,000	
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						
国債買入						
CP等買入				▲ 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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 100	300		100		
当預増減	▲ 18,500		▲ 20,300		4,000	
当座預金残高	3,904,800		3,884,500		3,888,500	
準備預金残高	3,411,900					
積み終了先	3,411,700					
超過準備	3,411,700				4月3日以降の残り所要積立額	
非準備預金先	492,900				積数 1,900	
					1日平均 200	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,127,000	
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	58.06%		

## ●2019年4月2日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日に続き資金余剰感が強く、レートは低位で推移した。朝方は地銀・信託・証券業態からの調達が見られ、▲0.086~▲0.02%の出会い。一巡後は閑散で、▲0.08%台の出会いが見られた程度であった。ターム物は月内物を中心に出会いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(4/3-4/4)は、▲0.085~▲0.075%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。10Y334~353、5Y130~138、30Y59~61などにビッドの出入りが見立った。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場は、翌日に3M物入札を控えて様子見閑散な中、3M物が▲0.1775%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、卸売・電機・機械業態で大型案件がみられ、償還は少額にとどまり、発行総額は2,600億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。本日はCP等買入オペアが、1,500億円オファーされた。オファー額が小さかったため、平均落札レート▲0.001%、按分落札レート▲0.002%と、前回比(平均▲0.005%、按分▲0.009%)で平均・按分共に大幅に上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/4/2	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.067				-	▲ 0.087	▲ 0.055	0.030	21,505.31	▲ 3.72	111.44-46	111.37-38
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.028				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.034				-	▲ 0.089						
3W			0.000				-	▲ 0.102						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.170	▲ 0.135						
6M							▲ 0.160	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.157						
									日付	3/26	3/27	3/28	3/29	4/1
									日銀当預残	3,920,200	3,914,900	3,939,100	3,940,300	3,923,300
									準備預金残	3,430,800	3,425,100	3,444,900	3,462,500	3,425,200
									マネタリーベース	5,042,500	5,037,700	5,063,000	5,064,400	5,046,700
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.066%	▲0.067%	▲0.060%	▲0.067%
									コール市場残高	102,083	101,818	101,142	51,166	95,607
									うち無担	89,570	89,588	85,566	41,283	68,089
									うちO/N	65,800	64,758	61,361	28,623	46,979
									うち有担	12,513	12,230	15,576	9,883	27,518

## ●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)
10年利付国債	354	0.10%	21,000	2019/4/3	2029/3/20	85,126.0	16,796.00	101.6000	▲0.0590%	37.4603%	101.6100	▲0.0600%	4,189.0

## ●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
CP等買入	1,500	2019/4/5			3,933	1,495	▲0.002		▲0.001	35.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,871	2019/4/2	2019/4/3		82	82		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/4/4	2019/4/11	2.91	0	0				

## ●2019年4月3日の予定

*4月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国3月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(823回)入札(3ヶ月、43,400億円、4/4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