

Central Daily Market Report

2019年4月3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	2019年4月3日		2019年4月4日		2019年4月5日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		▲ 400		0	
財政	▲ 19,300		▲ 700		1,000	
資金過不足	▲ 18,700		▲ 1,100		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						
国債買入			12,600			
CP等買入		▲ 100			1,500	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	▲ 18,800		11,600		2,500	
当座預金残高	3,886,000		3,897,600		3,900,100	
準備預金残高	3,414,500					
積み終了先	3,414,300					
超過準備	3,414,300				4月4日以降の残り所要積立額 積数 1,700	
非準備預金先	471,500				1日平均 100	
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	99.95%	日数	61.29%		

●2019年4月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、都銀・信託・地銀・証券業態を中心に▲0.086~▲0.02%の出会い。税揚げがあった一方で、交付税の支払いがあったため、レートは低位横ばいでの推移となった。ターム物は引き続き1~2W物を中心に出会いが散見された。

<レポ市場>

GCT/N(4/4-4/5)は、▲0.090~▲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目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.180%で出会い始め、最終的に▲0.170%の出会いで引ける展開となる中、平均落札利回▲0.1628%、按分落札利回▲0.1497%と按分レートが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発3M物が▲0.150%での出会いと按分レート近辺で推移した。この他に、引け際に6M物が▲0.160%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・不動産業態で大型案件がみられ、償還総額500億円程度に対して、発行総額は2,700億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。

●短期金融市場関連指標

2019/4/3	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.083	▲ 0.055	0.000	21,713.21	207.90	111.31-32	111.51-52
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.079						
2W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.030				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.123						
3M			▲ 0.030				▲ 0.155	▲ 0.133						
6M							▲ 0.160	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.157						
									日付	3/27	3/28	3/29	4/1	4/2
									日銀当預残	3,914,900	3,939,100	3,940,300	3,923,300	3,904,800
									準備預金残	3,425,100	3,444,900	3,462,500	3,425,200	3,411,900
									マネタリーベース	5,037,700	5,063,000	5,064,400	5,046,700	5,027,700
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.067%	▲0.060%	▲0.067%	▲0.067%
									コール市場残高	101,818	101,142	51,166	95,607	100,586
									うち無担	89,588	85,566	41,283	68,089	73,295
									うちO/N	64,758	61,361	28,623	46,979	49,385
									うち有担	12,230	15,576	9,883	27,518	27,291

●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)
国庫短期証券	823	-	43,400	2019/4/4	2019/7/8	108,096.1	35,351.5	100.0390	▲0.1497%	25.2570%	100.0424	▲0.1628%	8,048.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/4/4			9,214	3,505	0.003		0.004	79.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/4/4			11,794	4,008	0.002		0.003	6.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,800	2019/4/4			10,696	4,809	0.000		0.001	33.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,162	2019/4/3	2019/4/4		40	40		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	3,460	2019/4/3	2019/4/4		1	1		▲0.600	▲0.600	

●2019年4月4日の予定

*30年利付国債入札 (7,000億円、4/5発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、4/12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