

Central Daily Market Report

2019年4月4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	2019年4月4日 需給速報	2019年4月5日 需給予想	2019年4月8日 当社予想			
銀行券	▲ 400	200	1,000			
財政	600	▲ 3,000	1,000			
資金過不足	200	▲ 2,800	2,000			
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						▲ 5,100
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		1,500	▲ 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						
E T F買入			900			
国債補完供給	▲ 100	100	100			
当預増減	12,800	▲ 400	▲ 3,100			
当座預金残高	3,898,800	3,898,400	3,895,300			
準備預金残高	3,435,600					
積み終了先	3,435,400			4月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,435,400			積数	1,500	
非準備預金先	463,200			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	64.52%		

●2019年4月4日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、信託・地銀・証券業態を中心に調達が見られた。引き続き資金余剰感が強く、前日比横ばいの▲0.086~▲0.02%の出会い。一巡後は閑散で、▲0.08%近辺の出会い。ターム物はショートターム物の出会いが散見された程度であった。

<レポ市場>

GCT/N(4/5-4/8)は、▲0.095~▲0.080%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。10Y334~354、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。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.150~▲0.147%、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、卸売業態で大型案件がみられたが件数は少なく、償還総額600億円程度に対して、発行総額は1,300億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

2019/4/4	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	▲ 0.063				-	▲ 0.092	▲ 0.043	0.012	21,724.95	11.74	111.38-39	111.36-37
T/N			▲ 0.045				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.047				-	▲ 0.088						
2W							-	▲ 0.091						
3W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.042				-	▲ 0.101						
1M			▲ 0.040				-	▲ 0.127						
3M			▲ 0.033				▲ 0.148	▲ 0.134						
6M							▲ 0.160	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.157						
									日付	3/28	3/29	4/1	4/2	4/3
									日銀当預残	3,939,100	3,940,300	3,923,300	3,904,800	3,886,000
									準備預金残	3,444,900	3,462,500	3,425,200	3,411,900	3,414,500
									マネタリーベース	5,063,000	5,064,400	5,046,700	5,027,700	5,008,300
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.060%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.066%
									コール市場残高	101,142	51,166	95,607	100,586	102,882
									うち無担	85,566	41,283	68,089	73,295	76,114
									うちO/N	61,361	28,623	46,979	49,385	50,349
									うち有担	15,576	9,883	27,518	27,291	26,788

●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)
30年利付国債	62	0.50%	7,000	2019/4/5	2049/3/20	25,633.0	5,628.00	98.9000	0.5420%	18.8092%	98.9600	0.5400%	1,357.0
交付税特会	-	-	10,500	2019/4/12	2019/10/11	298,528.0	10,500.20		0.0000%	3.5174%		0.0000%	

●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)	26,027	2019/4/4	2019/4/5		86	86		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2019/4/4	2019/4/5		30	30		▲0.600	▲0.600	

●2019年4月5日の予定

- *2月の全世帯家計調査
市場予想：消費支出、前年比2.1%
- *2月の毎月勤労統計調査速報
- *2月の景気動向指数速報
- *3月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国2月の消費者信用残高
- *米国3月の雇用統計
- *国庫短期証券(824回)入札
(3ヶ月、43,400億円、4/8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