

# Central Daily Market Report

2019年4月8日(月)

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8日 需給速報	2019年4月9日 需給予想	2019年4月10日 当社予想
銀行券	500	200	0
財政	800	1,400	▲19,000
資金過不足	1,300	1,600	▲19,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	5,100	▲5,100	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		3,100	
CP等買入			
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	100		
国債補完供給	▲1,000	300	1,000
当預増減	700	5,700	▲19,000
当座預金残高	3,896,700	3,902,400	3,883,400
準備預金残高	3,424,800		
積み終了先	3,424,700		
超過準備	3,424,700		
非準備預金先	471,900		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,133,000
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数
			77.42%

## ●2019年4月8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強く、調達意欲が限定的な中、朝方は▲0.086~▲0.02%の幅広いレンジでの出合いで始まった。一巡後は閑散で、本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GCT/N(4/9-4/10)は、▲0.095~▲0.085%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。10Y334~354、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。アウトライ市場は、動意なく閑散な中、引け際に3M物が▲0.170%で出合った。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、鉄鋼業態でまとまった額の調達が行われたこともあり、発行総額は1,600億円程度と償還総額1,500億円程度を若干上回った。発行レートは概ね横ばい圏で推移している。

## ●短期金融市場関連指標

2019/4/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 先買参考統計値	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	▲0.050	▲0.015	21,761.65	▲45.85	111.71-72	111.44-46
T/N							-	▲0.093						
S/N							-	-						
1W	▲0.047	▲0.030	▲0.044				-	▲0.095						
2W			▲0.025				-	▲0.101						
3W							-	▲0.122						
1M							-	▲0.124						
3M							▲0.170	▲0.134						
6M							▲0.160	▲0.153						
1Y							▲0.160	▲0.157						
									日付	4/1	4/2	4/3	4/4	4/5
									日銀当預残	3,923,300	3,904,800	3,886,000	3,898,800	3,896,000
									準備預金残	3,425,200	3,411,900	3,414,500	3,435,600	3,420,800
									マネタリーベース	5,046,700	5,027,700	5,008,300	5,021,600	5,018,600
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.063%
									コール市場残高	95,607	100,586	102,882	94,109	104,605
									うち無担	68,089	73,295	76,114	70,610	79,939
									うちO/N	46,979	49,385	50,349	44,375	52,104
									うち有担	27,518	27,291	26,768	23,499	24,666

## ●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	業分率	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)	500	2019/4/9			3,631	500	0.002		0.002	99.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/4/9			4,360	1,810	▲0.014		▲0.013	86.2
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/4/9			1,841	505	▲0.006		▲0.006	77.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	115,204	2019/4/8	2019/4/9		826	826		▲0.600	▲0.600	

## ●2019年4月9日の予定

*2月の特定サービス産業動態統計速報	*国庫短期証券(825回)入札 (6ヶ月、23,000億円、4/10発行)	*5年利付国債入札 (19,000億円、4/10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