

# Central Daily Market Report

2019年4月9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9日		2019年4月10日		2019年4月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		▲ 300		0	
財政	▲ 1,600		▲ 17,600		2,000	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 17,900		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						
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				▲ 400		
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			200			
国債補完供給	▲ 200		1,000		200	
当預増減	2,400		▲ 17,900		2,000	
当座預金残高	3,899,100		3,881,200		3,883,200	
準備預金残高	3,442,700					
積み終了先	3,442,600				4月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,442,600				積数 700	
非準備預金先	456,400				1日平均 100	
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	99.98%	日数	80.65%		

## ●2019年4月9日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、続き資金余剰感が強く、朝方は信託・地銀・証券業態を中心に▲0.08~▲0.02%の出合いが見られた。一巡後も調達意欲は低調な中、本日の取引を終えた。ターム物は月中物の出合いが散見された程度であった。

### <レポ市場>

GCT/N(4/10-4/11)は、▲0.095~▲0.080%程度での出合い。SCはローラー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。アウトライト市場では、6M物の入札が実施された。WI取引において▲0.170%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1713%、按分落札利回▲0.1674%とWI取引を反映して堅調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発6M物が▲0.192~▲0.190%出合いと強含みで推移した。この他に、3M物が▲0.175~▲0.170%、1Y物が▲0.190~▲0.185%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、小売業態で比較的多量かつまとまった量での調達が見られ、償還総額30億円程度に対し、発行総額は1,300億円程度と発行超のマーケットとなった。発行レートは横ばい圏で推移している。本日はCP等買入オペアが1,500億円オファーされた。結果は平均落札レート0.001%、按分落札レート▲0.003%と、前回比(平均▲0.001%、按分▲0.002%)で平均は上昇、按分は低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2019/4/9	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	▲ 0.064				-	▲ 0.093	▲ 0.050	0.000	21,802.59	40.94	111.44-46	111.30-31
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.010	▲ 0.036				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.100						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.124						
1M	▲ 0.025	0.360	▲ 0.001				-	▲ 0.127						
3M	0.000	0.001	0.001				▲ 0.178	▲ 0.132						
6M							▲ 0.192	▲ 0.153						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.157						
									日付	4/2	4/3	4/4	4/5	4/8
									日銀当預残	3,904,800	3,886,000	3,898,800	3,896,000	3,896,700
									準備預金残	3,411,900	3,414,500	3,435,600	3,420,800	3,424,800
									マネタリーベース	5,027,700	5,008,300	5,021,600	5,018,600	5,018,700
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.066%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.063%
									コール市場残高	100,586	102,882	94,109	104,605	100,643
									うち無担	73,295	76,114	70,610	79,939	74,558
									うちO/N	49,385	50,349	44,375	52,104	45,913
									うち有担	27,291	26,768	23,499	24,666	26,085

## ●入札結果

名称	回数	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	825	-	23,000	2019/4/10	2019/10/10	90,476.0	18,655.6	100.0840	▲0.1674%	59.9213%	100.0860	▲0.1713%	4,344.0
5年利付国債	139	0.10%	19,000	2019/4/10	2024/3/20	81,627.0	15,360.0	101.3100	▲0.1620%	5.2806%	101.3200	▲0.1640%	3,630.0

## ●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	2019/4/12			2,760	1,480	▲0.003		0.001	61.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	12,969	2019/4/9	2019/4/10		176	176		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/4/11	2019/4/18	2.91	0	0				

## ●2019年4月10日の予定

*黒田日銀総裁、第94回信託大会において講演	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*交付税特別会計借入(10,500億円、4/19借入)
*2月の機械受注統計	*米国3月の財政収支	
市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+2.5%	*米国3月の消費者物価指数	
*3月の企業物価指数		

◆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