Central Daily Market Report

2019年4月10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10日 需給速報		2019年4月11日 需給予想		2019年4月12日 当社予想	
銀行券	▲ 300		▲ 1,500		▲ 1,000	
財政	▲ 18,300		900		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 18,600		▲ 600		▲ 3,000	
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			6,300			
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
ＥＴＦ買入	200		100			
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 18,600		5,700		▲ 1,500	

当座預金残高	3,880,500	3,886,200	3,884,700
準備預金残高	3,417,100		
積み終了先	3,417,000		
超過準備	3,417,000		
非準備預金先	463,400		

4月11日以降の残り所要積立額	
積数	600
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 83.87%

●2019年4月10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・証券業態の調達を中心に、▲0.08～▲0.025%の出合いで始まった。引き続き調達ニーズは弱く、一巡後は▲0.07%近辺の出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>
GCT/N(4/11-4/12)は、▲0.100～▲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、30Y59～62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、小幅低下した。アウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物が▲0.205～▲0.190%、6M物が▲0.200～▲0.1925%、1Y物が▲0.210～▲0.204%で出合うなど強含みで推移した。

<CP市場>
現先レートは同水準で推移した。発行市場は、卸売業態で1,000億円弱のまとまった額の調達が見られ、発行総額は1,300億円程度と償還総額の1,200億円弱を上回った。発行レートは引続き低位で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/4/10	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.064				－	▲ 0.093
T/N							－	▲ 0.089
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.098
2W			▲ 0.020				－	▲ 0.105
3W							－	▲ 0.128
1M			▲ 0.035				－	▲ 0.132
3M							▲ 0.190	▲ 0.137
6M							▲ 0.197	▲ 0.154
1Y							▲ 0.210	▲ 0.158

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.060	▲ 0.010	21,687.57	▲ 115.02	111.08-10	111.18-19

日付	4/3	4/4	4/5	4/8	4/9
日銀当預残	3,886,000	3,898,800	3,896,000	3,896,700	3,899,100
準備預金残	3,414,500	3,435,600	3,420,800	3,424,800	3,442,700
マネタリーベース	5,008,300	5,021,600	5,018,600	5,018,700	5,021,100
無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.064%
コール市場残高	102,882	94,109	104,605	100,643	100,141
うち無担	76,114	70,610	79,939	74,558	75,878
うちO/N	50,349	44,375	52,104	45,913	46,368
うち有担	26,768	23,499	24,666	26,085	24,263

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
交付税特会	－	－	10,500	2019/4/19	2019/10/18	297,872.0	10,500.08		0.0000%	3.5251%		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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,800	2019/4/11			14,896	4,815	▲0.013		▲0.011	13.5
国債買入（変動利付債）	1,000	2019/4/11			2,702	1,003	▲0.160		▲0.163	75.5
国債買入（物価連動債）	250	2019/4/11			851	251	0.000		▲0.051	20.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	11,594	2019/4/10	2019/4/11		0	0				

●2019年4月11日の予定

*3月のマネーストック
*米国3月の生産者物価指数
*流動性供給入札（5,000億円、4/12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。
◆本資料は何ら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論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