

Central Daily Market Report

2019年4月11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11日		2019年4月12日		2019年4月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,500		▲ 1,200		1,000	
財政	0		▲ 8,900		73,000	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 10,100		74,000	
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						▲ 1,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			7,500			
国債買入	6,300					
CP等買入		▲ 100	1,500	▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入	100		100			
国債補完供給						
当預増減	4,800		▲ 1,400		72,200	
当座預金残高	3,885,300		3,883,900		3,956,100	
準備預金残高	3,422,800					
積み終了先	3,422,700				4月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,422,700				積数	
非準備預金先	462,500				1日平均	
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	87.10%		

●2019年4月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、地銀・信託・証券業態から▲0.08~▲0.025%での調達で始まった。積み期間の後半ながら、調整の動きは限定的で、取り上がる動きは見られなかった。出会い巡後のレートは低位で推移した。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GCT/N(4/12-4/15)は、▲0.130~▲0.110%程度での出会い。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、30Y59~62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、低下した。アウトライト市場では、短国買入オベが7,500億円(前环比+2,500億円)でオファーされた。応札額が1兆7,476億円と多く、平均落札利回較差+0.015%、按分落札利回較差+0.005%と、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りからか、小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.200~▲0.195%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は電気機器業態で1,000億円超の大型案件が見られたことをはじめ、卸売やゴム製品、輸送用機器等複数業態でまとまった額の調達が散見され、活況なマーケットとなった。発行総額は5,000億円弱まで膨らみ、償還総額の2,300億円程度を大きく上回った。発行レートについては、発行残高が積み上がっている物で僅かに上昇したが、引続き0%近辺の狭いレンジで決着している。

●短期金融市場関連指標

2019/4/11	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				-	▲ 0.107	▲ 0.065	▲ 0.005	21,711.38	23.81	110.99-00	111.09-10
T/N			▲ 0.045				-	▲ 0.124						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.048	▲ 0.020	▲ 0.033				-	▲ 0.126						
2W							-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.137						
1M							-	▲ 0.138						
3M			▲ 0.005				▲ 0.198	▲ 0.138						
6M							▲ 0.197	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.158						
									日付	4/4	4/5	4/8	4/9	4/10
									日銀当預残	3,898,800	3,896,000	3,896,700	3,899,100	3,880,500
									準備預金残	3,435,600	3,420,800	3,424,800	3,442,700	3,417,100
									マネタリーベース	5,021,600	5,018,600	5,018,700	5,021,100	5,002,700
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.063%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%
									コール市場残高	94,109	104,605	100,643	100,141	103,188
									うち無担	70,610	79,939	74,558	75,878	80,593
									うちO/N	44,375	52,104	45,913	46,368	50,718
									うち有担	23,499	24,666	26,085	24,263	22,595

●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)
流動性供給	283	-	5,000	2019/4/12		14,195.0	4,986.0		0.0000%	10.6331%		▲0.0020%	

●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
国庫短期証券買入	7,500	2019/4/12			17,476	7,503	0.005		0.015	99.4

●2019年4月12日の予定

*4月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(826回)入札 (3ヶ月、43,000億円、4/15発行)	*エネルギー対策借入 (8,500億円、4/22借入)
---------------------	--	--------------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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