Central Daily Market Report

2019年4月15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15日 需給速報		2019年4月16日 需給予想		2019年4月17日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,200		0	
財政	77,600		4,400		▲ 5,000	
資金過不足	76,600		3,200		▲ 5,000	
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	1,900	▲ 1,800				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,400					
CP等買入		▲ 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						
ＥＴＦ買入	400					
国債補完供給	▲ 900	100		900		
当預増減	86,600		4,100		▲ 5,000	

当座預金残高	3,969,600	3,973,700	3,968,700
準備預金残高	3,465,500		
積み終了先	3,465,500		
超過準備	3,465,500		
非準備預金先	504,100		

4月16日以降の残り所要積立額	
積数	3,065,000
1日平均	102,200

積み期間（4/16～5/15）の所要準備額	3,065,000

準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%

●2019年4月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積みの最終日ながら、取り調整の動きは限定的で、朝方は邦銀の調達を中心に▲0.086～▲0.02%の出合いで始まった。一巡後も同水準の出合いが散見され、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(4/16-4/17)は、▲0.140～▲0.105%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、5Y130～139、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、低水準で推移した。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、銘柄に広がりは見られなかったものの、ノンバンク業態1社で1,000億円程度の大型案件が実施され、発行総額は1,400億円程度と償還総額の150億円程度を大きく上回った。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

2019/4/15	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	▲ 0.061				－	▲ 0.139
T/N							－	▲ 0.142
S/N							－	－
1W	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.043				－	▲ 0.140
2W			▲ 0.030				－	▲ 0.151
3W			▲ 0.030				－	▲ 0.151
1M			▲ 0.015				－	▲ 0.145
3M							▲ 0.190	▲ 0.145
6M							▲ 0.197	▲ 0.155
1Y							▲ 0.190	▲ 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）
▲ 0.035	0.020	22,169.11	298.55	112.03-04	111.91-92

日付	4/8	4/9	4/10	4/11	4/12
日銀当預残	3,896,700	3,899,100	3,880,500	3,885,300	3,883,000
準備預金残	3,424,800	3,442,700	3,417,100	3,422,800	3,396,600
マネタリーベース	5,018,700	5,021,100	5,002,700	5,009,000	5,008,000
無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%
コール市場残高	100,643	100,141	103,188	102,015	93,993
うち無担	74,558	75,878	80,593	79,058	74,835
うちO/N	45,913	46,368	50,718	49,163	44,985
うち有担	26,085	24,263	22,595	22,957	19,158

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ｉ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	186,262	2019/4/15	2019/4/16		792	792		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	10,000	2019/4/15	2019/4/16		85	85		▲0.600	▲0.600	

●2019年4月16日の予定

*米国3月の鉱工業生産・設備稼働率

*20年利付国債入札
（9,000億円、4/17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